

# 长盛安逸纯债债券型证券投资基金 2022 年中期报告

2022 年 6 月 30 日

基金管理人：长盛基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2022 年 8 月 27 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 08 月 26 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 2022 年 3 月 18 日起增加 E 类基金份额，E 类基金代码：015439。详情参阅本基金管理人于 2022 年 3 月 18 日披露的《关于长盛安逸纯债债券型证券投资基金增加 E 类基金份额并修改基金合同等法律文件的公告》。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
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
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>11</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	16
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>16</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	16
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>16</b>
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	18
6.3 净资产（基金净值）变动表	19
6.4 报表附注	23
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>44</b>
7.1 期末基金资产组合情况	44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	45
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	45
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	45

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	46
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	46
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	46
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	46
7.11 投资组合报告附注 .....	46
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>47</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	47
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	48
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	48
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>48</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>49</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	49
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	49
10.4 基金投资策略的改变 .....	49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	50
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	50
10.8 其他重大事件 .....	51
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>53</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	53
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	53
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>54</b>
12.1 备查文件目录 .....	54
12.2 存放地点 .....	54
12.3 查阅方式 .....	54

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	长盛安逸纯债债券型证券投资基金			
基金简称	长盛安逸纯债			
基金主代码	007744			
基金运作方式	契约型开放式			
基金合同生效日	2020 年 1 月 20 日			
基金管理人	长盛基金管理有限公司			
基金托管人	中国银行股份有限公司			
报告期末基金份额总额	3,207,775,627.91 份			
基金合同存续期	不定期			
下属分级基金的基金简称	长盛安逸纯债 A	长盛安逸纯债 C	长盛安逸纯债 D	长盛安逸纯债 E
下属分级基金的交易代码	007744	007745	013456	015439
报告期末下属分级基金的份额总额	1,445,611,898.26 份	522,919,740.81 份	0.00 份	1,239,243,988.84 份

注：报告期内，本基金自 2022 年 3 月 18 日起增加 E 类基金份额，并自该日起接受投资者对 E 类基金份额的申购和赎回。详情参阅本基金管理人于 2022 年 3 月 18 日披露的相关公告。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在控制风险和保持资产流动性的基础上，追求基金资产的长期稳健增值，并力争获得超过业绩比较基准的投资业绩。
投资策略	<p>（一）大类资产配置策略</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含：利率策略、类属配置策略、信用策略、相对价值策略、债券选择策略、资产支持证券等品种投资策略、国债期货投资策略。</p>
业绩比较基准	中债综合指数（全价）收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金，属证券投资基金中的较低风险品种，其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金。

### 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 姓名	张利宁	许俊

负责人	联系电话	010-86497608	95566
	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	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.csfunds.com.cn">http://www.csfunds.com.cn</a>
基金中期报告备置地点	基金管理人的办公地址及基金托管人住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	长盛基金管理有限公司	北京市朝阳区安定路 5 号院 3 号楼中建财富国际中心 3-5 层

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2022年01月01日-2022年06月30日)			2022年03月18日(基金合同生效日)-2022年06月30日
	长盛安逸纯债 A	长盛安逸纯债 C	长盛安逸纯债 D	长盛安逸纯债 E
本期已实现收益	16,997,335.67	5,968,074.64	-	5,650,836.60
本期利润	28,730,729.09	9,834,264.53	-	10,119,700.02
加权平均基金份额本期利润	0.0297	0.0263	-	0.0164
本期加权平均净值利润率	2.68%	2.40%	-	1.47%

本期基金份额净值增长率	3.04%	2.89%	3.04%	1.66%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022年6月30日)			
期末可供分配利润	43,898,662.22	10,520,724.55	-	37,456,345.91
期末可供分配基金份额利润	0.0304	0.0201	-	0.0302
期末基金资产净值	1,617,402,181.52	579,359,818.68	-	1,386,404,777.07
期末基金份额净值	1.1188	1.1079	1.1188	1.1188
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022年6月30日)			
基金份额累计净值增长率	11.88%	10.79%	6.33%	1.66%

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。表中的“期末”均指本报告期最后一日，即6月30日。

4、本基金自2021年09月02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。自2021年09月02日至2022年06月30日期间D类基金份额未发生申购业务，D类基金份额为0，D类基金份额净值参考A类基金份额净值披露。

5、本基金自2022年03月18日起增加E类基金份额，并自该日起接受投资者对E类基金份额的申购和赎回。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

长盛安逸纯债 A

第 7 页 共 54 页

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.21%	0.01%	-0.24%	0.03%	0.45%	-0.02%
过去三个月	1.56%	0.03%	0.29%	0.04%	1.27%	-0.01%
过去六个月	3.04%	0.04%	0.38%	0.05%	2.66%	-0.01%
过去一年	9.27%	0.05%	1.83%	0.05%	7.44%	0.00%
自基金合同生效起至今	11.88%	0.09%	2.25%	0.07%	9.63%	0.02%

## 长盛安逸纯债 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
过去一个月	0.19%	0.02%	-0.24%	0.03%	0.43%	-0.01%
过去三个月	1.48%	0.03%	0.29%	0.04%	1.19%	-0.01%
过去六个月	2.89%	0.04%	0.38%	0.05%	2.51%	-0.01%
过去一年	8.82%	0.05%	1.83%	0.05%	6.99%	0.00%
自基金合同生效起至今	10.79%	0.09%	2.25%	0.07%	8.54%	0.02%

## 长盛安逸纯债 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
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----



过去一个月	0.21%	0.01%	-0.24%	0.03%	0.45%	-0.02%
过去三个月	1.56%	0.03%	0.29%	0.04%	1.27%	-0.01%
过去六个月	3.04%	0.04%	0.38%	0.05%	2.66%	-0.01%
自基金新增本类份额起至今	6.33%	0.04%	0.76%	0.05%	5.57%	-0.01%

## 长盛安逸纯债 E

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.21%	0.02%	-0.24%	0.03%	0.45%	-0.01%
过去三个月	1.56%	0.03%	0.29%	0.04%	1.27%	-0.01%
自基金新增本类份额起至今	1.66%	0.03%	0.37%	0.04%	1.29%	-0.01%

注：本基金业绩比较基准的构建：

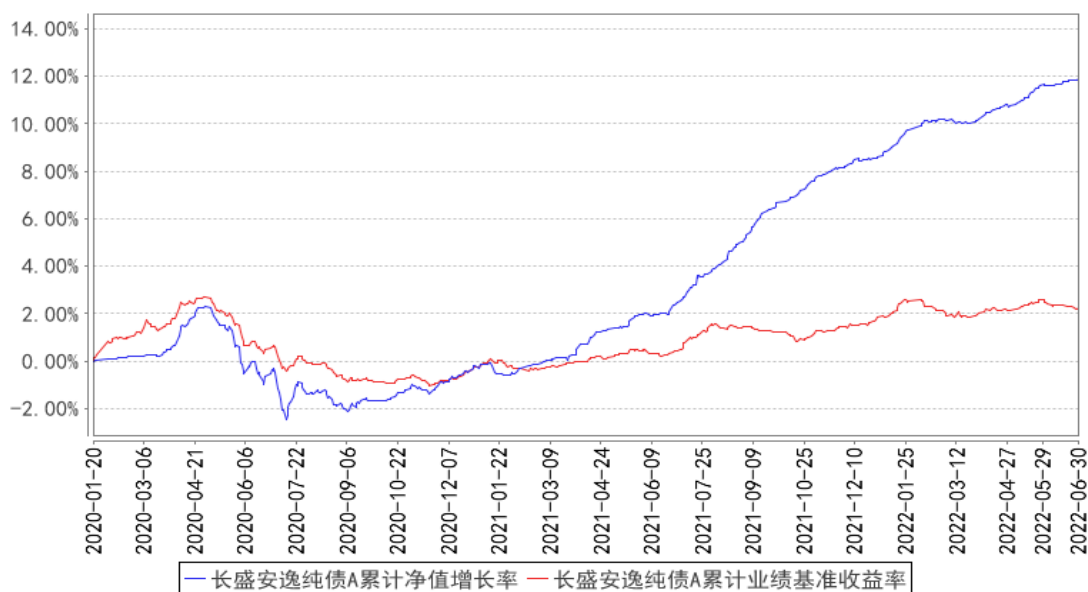
本基金业绩比较基准为中债综合指数（全价）收益率。

中债综合指数（全价）由中央国债登记结算有限责任公司编制并发布，该指数样本具有广泛的市场代表性，涵盖了主要交易市场（银行间市场、交易所市场等）、不同发行主体（政府、企业等）和期限（长期、中期、短期等）。

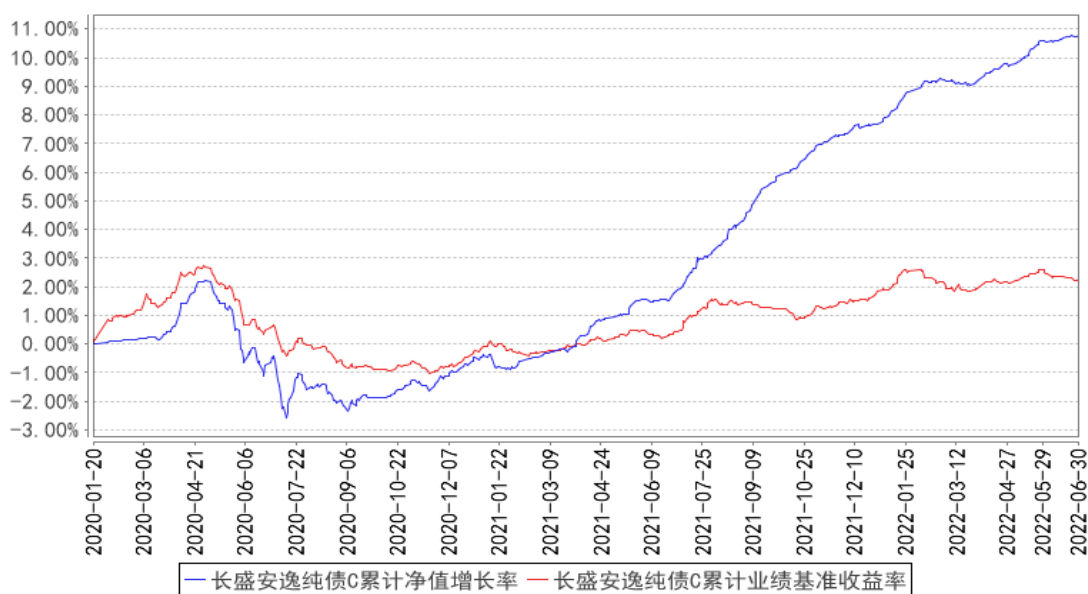
本基金为债券型基金，投资范围为固定收益类金融工具，且本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产，也不参与一级市场新股申购和新股增发，可转换债券仅投资可分离交易可转债的纯债部分。鉴于中债综合指数(全价)能够反映债券全市场的整体价格和投资回报情况，所以以其收益率作为本基金的业绩比较基准。

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

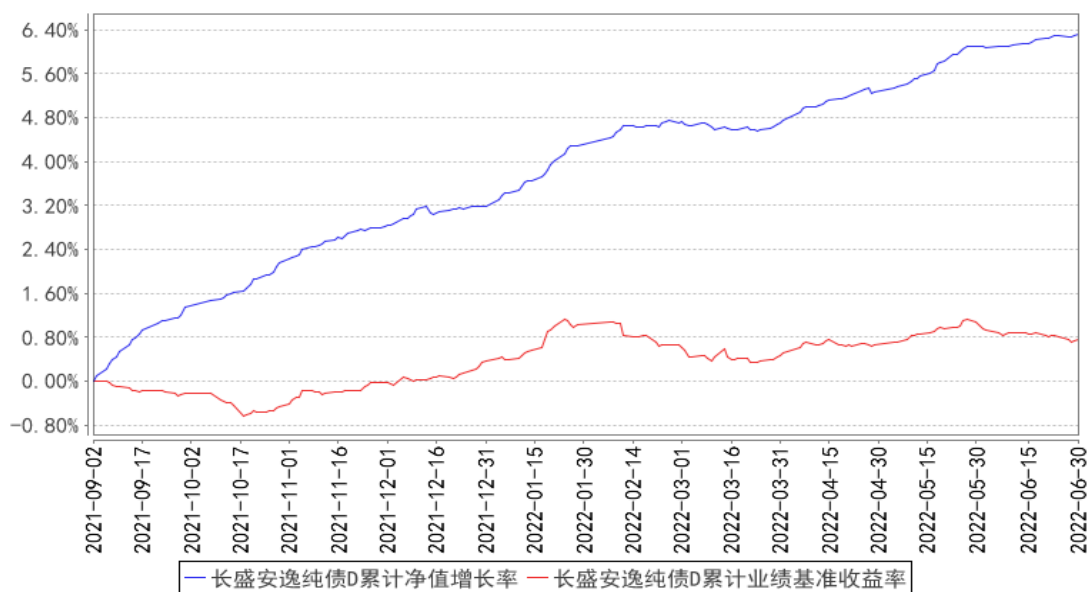
长盛安逸纯债A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



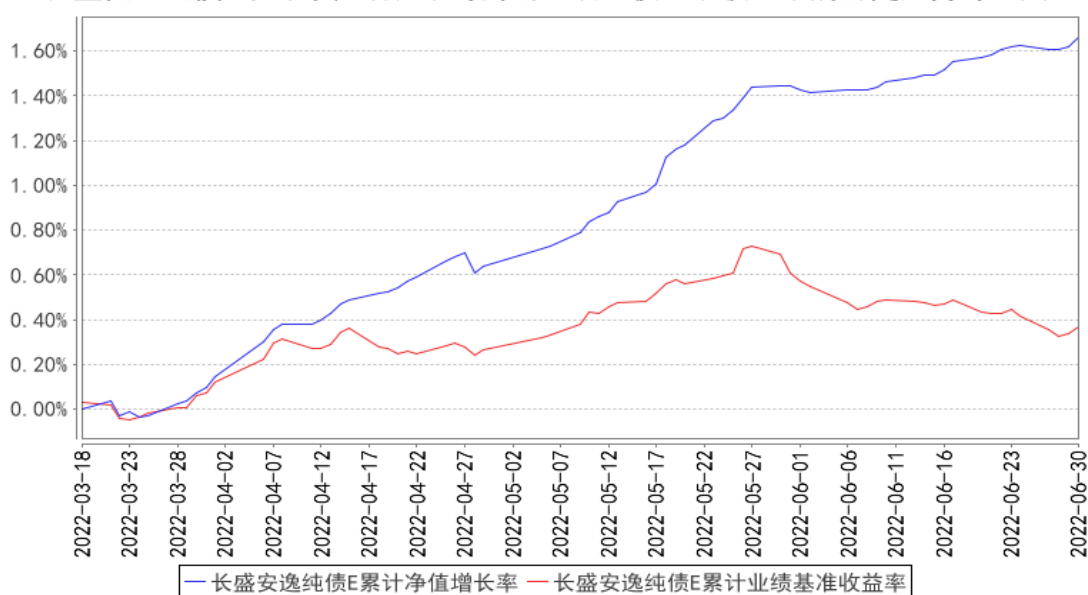
长盛安逸纯债C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



长盛安逸纯债D累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



长盛安逸纯债E累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金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 2022 年 6 月 30 日，基金管理人共管理七十只开放式基金，并管理多个全国社保基金组合和私募资产管理计划。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王贵君	本基金基金经理，长盛盛裕纯债债券型证券投资基金基金经理，长盛盛和纯债债券型证券投资基金基金经理，长盛稳益 6 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理，长盛全债指数增强型债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 1 月 13 日	-	10 年	王贵君先生，硕士。曾任中债资信评估有限责任公司评级分析师，上投摩根基金管理有限公司债券研究员，2017 年 6 月加入长盛基金管理有限公司，历任投资经理、专户理财部副总监、基金经理等。

注：1、上表基金经理的任职日期和离任日期均指公司决定确定的聘任日期和解聘日期；

2、“证券从业年限”中“证券从业”的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本基金本报告期内无基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施准则、本基金基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行《公司公平交易细则》各项规定，在研究、投资授权与决策、交易执行等各个环节，公平对待旗下所有投资组合，包括公募基金、社保组合、私募资产管理计划等。具体如下：

研究支持，公司旗下所有投资组合共享公司研究部门研究成果，所有投资组合经理在公司研究平台上拥有同等权限。

投资授权与决策，公司实行投资决策委员会领导下的投资组合经理负责制，各投资组合经理在投资决策委员会的授权范围内，独立完成投资组合的管理工作。各投资组合经理遵守投资信息隔离墙制度。

交易执行，公司实行集中交易制度，所有投资组合的投资指令均由交易部统一执行委托交易。交易部依照《公司公平交易细则》的规定，场内交易，强制开启恒生交易系统公平交易程序；场外交易，严格遵守相关工作流程，保证交易执行的公平性。

投资管理行为的监控与分析评估，公司风险管理部、监察稽核部，依照《公司公平交易细则》的规定，持续、动态监督公司投资管理全过程，并进行分析评估，及时向公司管理层报告发现问题，保障公司旗下所有投资组合均被公平对待。

公司对过去 4 个季度的同向交易行为进行数量分析，计算溢价率、贡献率、占优比等指标，使用双边 90%置信水平对 1 日、3 日、5 日的交易片段进行 T 检验，未发现违反公平交易及利益输送的行为。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，未发现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

##### 1、报告期内行情回顾

上半年债市整体平稳，波动不大。不同板块表现分化，信用债表现好于利率债，受货币政策预期变化的影响，中短端利率波动更加明显。市场大致分为三个阶段：

第一阶段：年初以来，货币政策宽松预期升温，市场延续涨势，受资金利率影响较大的信用债和中短端品种，收益率降幅更大，中长端利率品种受制于宽信用预期，表现相对犹豫，该阶段

市场收益率呈现牛陡式下行；

第二阶段：由于 1 月份社融数据表现超预期、房地产政策开始转暖，稳增长预期逐渐升温，2 月中旬开始，市场收益率震荡上行，中短端利率上行更为明显；

第三阶段：三月下旬开始，受二次疫情冲击，叠加海外俄乌冲突，经济预期明显恶化，央行引导资金利率中枢下移，市场重回涨势，在这一阶段信用债和中短端品种收益率创年内新低。

## 2、报告期内本基金投资策略分析

报告期内，本基金在操作中严格遵守基金合同要求构建投资组合。由于上半年债券市场窄幅波动为主，因此，组合持仓以存在票息优势的信用债为主，一定程度降低了组合的波动。上半年组合持仓结构稳定，组合久期偏短，在二季度初市场超跌阶段，增加了久期和杠杆。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末长盛安逸纯债 A 的基金份额净值为 1.1188 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.04%，同期业绩比较基准收益率为 0.38%；截至本报告期末长盛安逸纯债 C 的基金份额净值为 1.1079 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.89%，同期业绩比较基准收益率为 0.38%；截至本报告期末长盛安逸纯债 D 的基金份额净值为 1.1188 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.04%，同期业绩比较基准收益率为 0.38%；截至本报告期末长盛安逸纯债 E 的基金份额净值为 1.1188 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.66%，同期业绩比较基准收益率为 0.37%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，经济有望延续反弹态势，但内生增长动能仍然偏弱，消费复苏乏力，地产销售和投资的不确定性仍然较高，海外经济的回落压力可能拖累外需，同时，疫情的反复也将增加经济的不确定性。

政策方面，货币政策在美联储加息、人民币存在贬值压力、大宗商品高位运行的背景下，短期看将以结构性政策为主，总量政策受到制约，随着疫情缓解经济逐渐恢复，资金面存在一定的均值回归压力。财政政策方面，下半年仍有赖政府加杠杆、财政谋划增量，仍不排除发行特别国债或提前发行专项债的可能性。

信用债方面，目前信用利差处于低位，如果资金利率逐渐恢复到正常水平，信用利差存在反弹压力。宏观层面，受疫情冲击发债主体内部现金流有所弱化，资产负债表修复有赖于经济的企稳复苏，因此，下半年宏观信用环境存在不确定性，其中，企业盈利能力的恢复和社融增长对现金流的补充，可能是关注的重点。结构方面，产业类国企整体盈利尚可，但内部开始分化，城投债短期受益政策托底，但中长期面临财政融资“回表”和土地市场低迷双重制约。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及本基金合同约定，本基金管理人严格按照《企业会计准则》、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持投资品种进行估值。本基金管理人制订了证券投资基金估值政策与估值程序，设立基金估值小组，参考行业协会估值意见和独立第三方机构估值数据，确保基金估值的公平、合理。

本基金管理人制订的证券投资基金估值政策与估值程序确定了估值目的、估值日、估值对象、估值程序、估值方法以及估值差错处理、暂停估值和特殊情形处理等事项。本基金管理人设立了由公司总经理（担任估值工作小组组长）、公司督察长（担任估值工作小组副组长）、公司相关投资、研究部门分管领导、公司业务运营部分管领导、相关研究部门、相关投资部门、监察稽核部、风险管理部、信息技术部及业务运营部总监或指定人员组成的估值工作小组，负责研究、指导并执行基金估值业务。小组成员均具有多年证券、基金从业经验，具备基金估值运作、行业研究、风险管理或法律合规等领域的专业胜任能力。

基金经理参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

参与估值流程的各方还包括本基金托管人和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任，当存有异议时，托管人有责任要求基金管理公司作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同对基金利润分配原则的约定，本报告期内未实施利润分配。

本基金截至 2022 年 6 月 30 日，期末可供分配利润为 91,875,732.68 元，其中长盛安逸纯债 A 期末可供分配利润为 43,898,662.22 元（长盛安逸纯债 A 的未分配利润已实现部分为 43,898,662.22 元，未分配利润未实现部分为 127,891,621.04 元）；长盛安逸纯债 C 期末可供分配利润 10,520,724.55 元（长盛安逸纯债 C 的未分配利润已实现部分为 10,520,724.55 元，未分配利润未实现部分为 45,919,353.32 元）；长盛安逸纯债 E 期末可供分配利润 37,456,345.91 元（长盛安逸纯债 E 的未分配利润已实现部分为 37,456,345.91 元，未分配利润未实现部分为 109,704,442.32 元）。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在长盛安逸纯债债券型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

#### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

### § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：长盛安逸纯债债券型证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	15,027,591.21	14,562,652.23
结算备付金		11,068,733.22	1,165,564.27
存出保证金		125,475.05	33,966.94
交易性金融资产	6.4.7.2	3,626,860,703.55	985,709,352.50
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-



债券投资		3,626,860,703.55	985,709,352.50
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	10,002,739.73	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		9,572,678.61	-
应收股利		-	-
应收申购款		16,272,497.54	2,738,318.35
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	17,424,156.25
资产总计		3,688,930,418.91	1,021,634,010.54
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022年6月30日</b>	<b>上年度末 2021年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		70,003,006.01	92,000,000.00
应付清算款		-	6,742,849.32
应付赎回款		33,126,827.77	10,414,543.59
应付管理人报酬		1,587,542.33	390,878.35
应付托管费		529,180.77	130,292.79
应付销售服务费		130,982.36	54,129.18
应付投资顾问费		-	-
应交税费		243,060.07	80,054.59
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	143,042.33	27,611.89
负债合计		105,763,641.64	109,840,359.71
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	3,207,775,627.91	841,381,231.88
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	375,391,149.36	70,412,418.95
净资产合计		3,583,166,777.27	911,793,650.83
负债和净资产总计		3,688,930,418.91	1,021,634,010.54

注：（1）报告截止日 2022 年 6 月 30 日，长盛安逸纯债 A 基金份额净值 1.1188 元，基金份额总

额 1,445,611,898.26 份；长盛安逸纯债 C 基金份额净值 1.1079 元，基金份额总额 522,919,740.81 份；长盛安逸纯债 D 基金份额净值 1.1188 元，基金份额总额 0.00 份；长盛安逸纯债 E 基金份额净值 1.1188 元，基金份额总额 1,239,243,988.84 份。长盛安逸纯债份额总额合计为 3,207,775,627.91 份。

(2) 以上比较数据已根据本年《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>》中的资产负债表格式的要求进行列示：2021 年年度报告资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在 2022 年中期报告资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，2021 年年度报告资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在 2022 年中期报告资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

## 6.2 利润表

会计主体：长盛安逸纯债债券型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		58,653,561.12	502,589.26
1. 利息收入		123,947.59	589,368.71
其中：存款利息收入	6.4.7.9	115,340.07	6,199.49
债券利息收入		-	569,822.94
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		8,607.52	13,346.28
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		38,101,304.70	-1,002,287.32
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	38,101,304.70	-1,002,287.32
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.12	-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	-	-
股利收益	6.4.7.14	-	-
以摊余成本计量的金		-	-

融资产终止确认产生的收益			
其他投资收益			-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	20,068,446.73	896,508.90
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）			-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	359,862.10	18,998.97
<b>减：二、营业总支出</b>		9,968,867.48	167,457.87
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	5,500,545.00	65,120.48
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,833,514.96	21,706.84
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	602,760.78	7,752.40
4. 投资顾问费			-
5. 利息支出		1,771,759.66	18,449.29
其中：卖出回购金融资产支出		1,771,759.66	18,449.29
6. 信用减值损失			-
7. 税金及附加		116,758.50	1,562.50
8. 其他费用	6.4.7.17	143,528.58	52,866.36
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		48,684,693.64	335,131.39
减：所得税费用			-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		48,684,693.64	335,131.39
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>			-
<b>六、综合收益总额</b>		48,684,693.64	335,131.39

注：以上比较数据已根据本年《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>》中的利润表格式的要求进行列示；2021 年中期报告利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在 2022 年中期报告利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：长盛安逸纯债债券型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基	841,381,231.88	-	70,412,418.95	911,793,650.83

金净值)				
加:会计 政策变 更	-	-	-	-
前 期差 错 更 正	-	-	-	-
其 他	-	-	-	-
二、本 期 初 净 资 产 (基 金 净 值)	841,381,231.88	-	70,412,418.95	911,793,650.83
三、本 期 增 减 变 动 额 (减 少 以 “-” 号 填 列)	2,366,394,396.03	-	304,978,730.41	2,671,373,126.44
(一)、 综 合 收 益 总 额	-	-	48,684,693.64	48,684,693.64
(二)、 本 期 基 金 份 额 交 易 产 生 的 基 金 净 值 变 动 数 (净 值 减 少 以 “-” 号 填 列)	2,366,394,396.03	-	256,294,036.77	2,622,688,432.80
其中:1. 基 金 申 购 款	2,945,170,740.70	-	313,379,456.00	3,258,550,196.70
2 .基 金 赎 回 款	-578,776,344.67	-	-57,085,419.23	-635,861,763.90
(三)、 本 期 向 基 金 份 额 持 有 人 分 配 利 润 产 生 的 基	-	-	-	-

金净值变动(净值减少以“-”号填列)				
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产(基金净值)	3,207,775,627.91	-	375,391,149.36	3,583,166,777.27
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	30,391,122.33	-	-63,190.01	30,327,932.32
加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	30,391,122.33	-	-63,190.01	30,327,932.32
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-16,615,927.75	-	380,841.78	-16,235,085.97
(一)、综合收益总额	-	-	335,131.39	335,131.39
(二)、本期基金份额	-16,615,927.75	-	45,710.39	-16,570,217.36

交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）				
其中：1. 基金申购款	73,975,580.37	-	597,419.81	74,573,000.18
2. 基金赎回款	-90,591,508.12	-	-551,709.42	-91,143,217.54
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	13,775,194.58	-	317,651.77	14,092,846.35

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

周兵

基金管理人负责人

刁俊东

主管会计工作负责人

龚珉

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

长盛安逸纯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]1144号《关于准予长盛安逸纯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12月24日至2020年1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(2020)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2020年1月20日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。截至2020年1月17日止,本基金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188,255,013.34元,折合188,255,013.34份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56,255.95元,折合56,255.95份A类基金份额;以上收到的实收基金共计人民币188,311,269.29元,折合188,311,269.29份A类基金份额。本基金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63,699,447.14元,折合63,699,447.14份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13,050.13元,折合13,050.13份C类基金份额;以上收到的实收基金共计人民币63,712,497.27元,折合63,712,497.27份C类基金份额。本基金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252,023,766.56元,分别折合成A类及C类基金份额,合计折合252,023,766.56份基金份额。本基金的基金管理人和注册登记机构为长盛基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金根据申购费、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者申购时收取申购费用、但不从本类别基金资产中计提销售服务费的,包括A类基金份额、D类基金份额和E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、D类和E类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同,本基金A类基金份额、C类基金份额、D类基金份额和E类基金份额将分别计算并公告基金份额净值。

本基金主要投资于固定收益类金融工具,包括债券(包括国债、金融债(含政策性金融债、商业银行金融债以及其他金融机构发行的金融债等)、企业债、公司债、次级债、地方政府债、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、分离交易可转债的纯债部分、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及其他经中国证监会允许基金投资的债券),以及资产支持证券、债券回购、同业存单、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)、现金等固定收益类金融工具,国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他

金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金不投资于股票等权益类资产，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。本基金的投资组合比例为：本基金对债券的投资比例不低于基金资产的 80%，每个交易日日终，在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。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。本基金的业绩比较基准为：中债综合指数（全价）收益率。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

除下述变更后的会计政策外，本基金报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

##### 6.4.4.1 金融资产和金融负债的分类

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

##### (1) 金融资产分类

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

##### (2) 金融负债分类



本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

#### 6.4.4.2 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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

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

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，其公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益；

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

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

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

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

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

发生信用减值的金融资产；

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

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

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

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

#### 6.4.4.3 收入/（损失）的确认和计量

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

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

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

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

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

(4) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

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

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

(7) 转融通证券出借业务中，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入，将出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为投资收益；

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

## 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

#### 新金融工具准则

根据《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（统称“新金融工具准则”）、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法规的要求，本基金自 2022 年 1 月 1 日开始按照新金融工具准则进行会计处理，根据衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与现行准则的差异追溯调整本报告期初未分配利润。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，确定了三个主要的计量类别：摊余成本；以公允价值计量且其变动计入其他综合收益；以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”，适用于以摊余成本计量的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本基金的影响不重大。

本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在相关“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等项目中，不单独列示“应收利息”项目或“应付利息”项目。

“信用减值损失”项目，反映本基金计提金融工具信用损失准备所确认的信用损失。本基金将分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法计算的利息收入反映在“利息收入”项目中，其他项目的利息收入从“利息收入”项目调整至“投资收益”项目列示。

于首次执行日（2022 年 1 月 1 日），原金融资产和金融负债账面价值调整为按照修订后金融工具确认和计量准则的规定进行分类和计量的新金融资产和金融负债账面价值的调节如下所述：

以摊余成本计量的金融资产：

银行存款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 14,562,652.23 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 2,599.33 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，银行存款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 14,565,251.56 元。

结算备付金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 1,165,564.27 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 524.50 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，结算备付金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 1,166,088.77 元。

存出保证金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 33,966.94 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 15.30 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，存出保证金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 33,982.24 元。

应收申购款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 2,738,318.35 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 0.00 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，应收申购款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 2,738,318.35 元。

应收利息于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 17,424,156.25 元，转出至银行存款的重分类金额为人民币 2,599.33 元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币 524.50 元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币 15.30 元，转出至交易性金融资产的重分类金额为人民币 17,421,017.12 元。经上述重分类后，应收利息不再作为财务报表项目单独列报。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产：

交易性金融资产于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 985,709,352.50 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 17,421,017.12 元。经上述重分类后，交易性金融资产于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 1,003,130,369.62 元。

以摊余成本计量的金融负债：

卖出回购金融资产款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 92,000,000.00 元，自应付利息转入的重分类金额为人民币 -42,493.15 元。经上述重分类后，卖出回购金融资产款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 91,957,506.85 元。

应付利息于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币-42,493.15 元，转出至卖出回购金融资产款的重分类金额为人民币-42,493.15 元。经上述重分类后，应付利息不再作为财务报表项目单独列报。

除上述财务报表项目外，于首次执行日，新金融工具准则的执行对财务报表其他金融资产和金融负债项目无影响。

于首次执行日，新金融工具准则的执行对本基金金融资产计提的减值准备金额无重大影响。

上述会计政策变更未导致本基金本期期初未分配利润的变化。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 6.4.6 税项

##### 6.4.6.1 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人

可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额；

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按规定的比例缴纳。

#### 6.4.6.2 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

#### 6.4.6.3 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
活期存款	15,027,591.21
等于：本金	15,022,906.02
加：应计利息	4,685.19

减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	15,027,591.21

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	-	-	-	-	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	1,024,425,668.42	17,515,672.94	1,044,852,143.54	2,910,802.18
	银行间市场	2,517,279,472.28	41,421,640.01	2,582,008,560.01	23,307,447.72
	合计	3,541,705,140.70	58,937,312.95	3,626,860,703.55	26,218,249.90
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	3,541,705,140.70	58,937,312.95	3,626,860,703.55	26,218,249.90	

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 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 2022 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	10,002,739.73	-
合计	10,002,739.73	-

## 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

## 6.4.7.5 其他资产

无。

## 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	14,052.64
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	20,810.74
其中：交易所市场	-
银行间市场	20,810.74
应付利息	-
预提费用	108,178.95
合计	143,042.33

## 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

## 长盛安逸纯债 A

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	640,098,578.35	640,098,578.35
本期申购	1,048,217,695.38	1,048,217,695.38
本期赎回（以“-”号填列）	-242,704,375.47	-242,704,375.47
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	1,445,611,898.26	1,445,611,898.26

## 长盛安逸纯债 C

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	201,282,653.53	201,282,653.53
本期申购	642,829,423.94	642,829,423.94
本期赎回（以“-”号填列）	-321,192,336.66	-321,192,336.66
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-



本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	522,919,740.81	522,919,740.81

## 长盛安逸纯债 E

项目	本期 2022年3月18日（基金合同生效日）至2022年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	-	-
本期申购	1,254,123,621.38	1,254,123,621.38
本期赎回（以“-”号填列）	-14,879,632.54	-14,879,632.54
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	1,239,243,988.84	1,239,243,988.84

注：申购含转换入，赎回含转换出。

## 6.4.7.8 未分配利润

## 长盛安逸纯债 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	7,966,840.17	46,979,217.42	54,946,057.59
本期利润	16,997,335.67	11,733,393.42	28,730,729.09
本期基金份额交易产生的变动数	18,934,486.38	69,179,010.20	88,113,496.58
其中：基金申购款	24,486,932.80	89,002,723.79	113,489,656.59
基金赎回款	-5,552,446.42	-19,823,713.59	-25,376,160.01
本期已分配利润	-	-	-
本期末	43,898,662.22	127,891,621.04	171,790,283.26

## 长盛安逸纯债 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	799,346.51	14,667,014.85	15,466,361.36
本期利润	5,968,074.64	3,866,189.89	9,834,264.53
本期基金份额交易产生的变动数	3,753,303.40	27,386,148.58	31,139,451.98
其中：基金申购款	7,700,552.17	53,412,999.17	61,113,551.34
基金赎回款	-3,947,248.77	-26,026,850.59	-29,974,099.36
本期已分配利润	-	-	-
本期末	10,520,724.55	45,919,353.32	56,440,077.87

## 长盛安逸纯债 E

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-	-	-
本期利润	5,650,836.60	4,468,863.42	10,119,700.02
本期基金份额交易产生的变动数	31,805,509.31	105,235,578.90	137,041,088.21

其中：基金申购款	32,235,453.85	106,540,794.22	138,776,248.07
基金赎回款	-429,944.54	-1,305,215.32	-1,735,159.86
本期已分配利润	-	-	-
本期末	37,456,345.91	109,704,442.32	147,160,788.23

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2022年1月1日至2022年6月30日	
活期存款利息收入		48,291.68
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		66,292.94
其他		755.45
合计		115,340.07

#### 6.4.7.10 股票投资收益

无。

#### 6.4.7.11 债券投资收益

##### 6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	
	2022年1月1日至2022年6月30日	
债券投资收益——利息收入		39,942,684.30
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入		-1,841,379.60
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		38,101,304.70

##### 6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2022年1月1日至2022年6月30日	
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额		728,880,572.48
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额		717,329,746.26
减：应计利息总额		13,367,341.82
减：交易费用		24,864.00
买卖债券差价收入		-1,841,379.60

## 6.4.7.12 贵金属投资收益

无。

## 6.4.7.13 衍生工具收益

无。

## 6.4.7.14 股利收益

无。

## 6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
1. 交易性金融资产	20,068,446.73
股票投资	-
债券投资	20,068,446.73
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	20,068,446.73

## 6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
基金赎回费收入	354,075.28
基金转换费收入	5,786.82
合计	359,862.10

## 6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
审计费用	39,671.58
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	25,899.63
账户维护费	17,850.00
其他	600.00

合计	143,528.58
----	------------

#### 6.4.7.18 分部报告

无。

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

无。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要说明的重大资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内，未存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
长盛基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金代销机构
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

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

###### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6 月30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	5,500,545.00	65,120.48
其中：支付销售机构的客户维护费	1,045,644.65	25,257.63

注：支付基金管理人长盛基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.60%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.60\% / \text{当年天数}。$$

###### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,833,514.96	21,706.84

注：支付基金托管人中国银行的基金托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

其计算公式为：每日应计提的基金托管费 = 前一日的基金资产净值 × 0.20% / 当年天数。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日				
	当期发生的基金应支付的销售服务费				
	长盛安逸纯债 A	长盛安逸纯债 C	长盛安逸纯债 D	长盛安逸纯债 E	合计
长盛基金公司	-	881.78	-	-	881.78
中国银行	-	8461.5	-	-	8461.5
国元证券	-	168.85	-	-	168.85
合计	-	9,512.13	-	-	9,512.13
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日				
	当期发生的基金应支付的销售服务费				
	长盛安逸纯债 A	长盛安逸纯债 C	长盛安逸纯债 D	长盛安逸纯债 E	合计
长盛基金公司	-	3,592.98	-	-	3,592.98
中国银行	-	2,006.11	-	-	2,006.11
国元证券	-	257.43	-	-	257.43
合计	-	5,856.52	-	-	5,856.52

注：基金销售服务费每日计提，按月支付。基金销售服务费可用于本基金的市场推广、销售以及基金份额持有人服务等各项费用。本基金分为不同的类别，适用不同的销售服务费率。其中，本基金 A 类基金份额、D 类基金份额、E 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 0.30% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% / \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

## 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

## 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

## 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

## 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

## 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本基金本报告期无基金管理人运用自有资金投资本基金的情况。

## 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

## 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30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	15,027,591.21	48,291.68	117,023.21	5,223.97
合计	15,027,591.21	48,291.68	117,023.21	5,223.97

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

## 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

## 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

## 6.4.11 利润分配情况

无。

## 6.4.12 期末(2022年6月30日)本基金持有的流通受限证券

## 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

## 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2022 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 50,003,006.01 元，是以如下债券作为抵押：

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
220007	22 付息国债 07	2022 年 7 月 7 日	99.85	600,000	59,911,906.85
合计				600,000	59,911,906.85

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2022 年 6 月 30 日止，本基金从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 20,000,000.00 元，于 2022 年 7 月 1 日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

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

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
A-1	21,065,726.03	-
A-1 以下	-	-
未评级	323,389,668.50	116,311,600.00
合计	344,455,394.53	116,311,600.00

注：未评级部分为国债、政策性金融债、企业超短期融资券和企业短期融资券。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	9,987,807.69	-
合计	9,987,807.69	-

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
AAA	2,275,963,320.44	602,397,390.00
AAA 以下	580,164,744.68	160,574,662.50
未评级	416,289,436.21	106,425,700.00
合计	3,272,417,501.33	869,397,752.50

注：未评级部分为国债、政策性金融债和中期票据。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。



### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控流动性受限资产比例、流动性资产比例及压力测试等方式防范流动性风险，并对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市或在银行间同业市场交易，因此，除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，本基金所持大部分资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注 6.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的公允价值和未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

## 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	15,022,906.02	-	-	4,685.19	15,027,591.21
结算备付金	11,064,252.21	-	-	4,481.01	11,068,733.22
存出保证金	125,424.20	-	-	50.85	125,475.05
交易性金融资产	1,680,927,847.30	1,674,616,543.30	212,379,000.00	58,937,312.95	3,626,860,703.55
买入返售金融资产	10,000,125.00	-	-	2,614.73	10,002,739.73
应收申购款	-	-	-	16,272,497.54	16,272,497.54
应收清算款	-	-	-	9,572,678.61	9,572,678.61
资产总计	1,717,140,554.73	1,674,616,543.30	212,379,000.00	84,794,320.88	3,688,930,418.91
负债					
应付赎回款	-	-	-	33,126,827.77	33,126,827.77
应付管理人报酬	-	-	-	1,587,542.33	1,587,542.33
应付托管费	-	-	-	529,180.77	529,180.77
卖出回购金融资产款	69,999,805.00	-	-	3,201.01	70,003,006.01
应付销售服务费	-	-	-	130,982.36	130,982.36
应交税费	-	-	-	243,060.07	243,060.07
其他负债	-	-	-	143,042.33	143,042.33
负债总计	69,999,805.00	-	-	35,763,836.64	105,763,641.64
利率敏感度缺口	1,647,140,749.73	1,674,616,543.30	212,379,000.00	49,030,484.24	3,583,166,777.27
上年度末 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	14,562,652.23	-	-	-	14,562,652.23
结算备付金	1,165,564.27	-	-	-	1,165,564.27
存出保证金	33,966.94	-	-	-	33,966.94
交易性金融资产	487,695,703.90	498,013,648.60	-	-	985,709,352.50
应收申购款	-	-	-	2,738,318.35	2,738,318.35
其他资产	-	-	-	17,424,156.25	17,424,156.25
资产总计	503,457,887.34	498,013,648.60	-	20,162,474.60	1,021,634,010.54
负债					
卖出回购金融资产款	92,000,000.00	-	-	-	92,000,000.00
应付证券清算款	-	-	-	6,742,849.32	6,742,849.32
应付赎回款	-	-	-	10,414,543.59	10,414,543.59
应付管理人报酬	-	-	-	390,878.35	390,878.35
应付托管费	-	-	-	130,292.79	130,292.79
应付销售服务费	-	-	-	54,129.18	54,129.18
应交税费	-	-	-	80,054.59	80,054.59
其他负债	-	-	-	27,611.89	27,611.89

负债总计	92,000,000.00	-	-	17,840,359.71	109,840,359.71
利率敏感度缺口	411,457,887.34	498,013,648.60	-	2,322,114.89	911,793,650.83

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。

#### 6.4.13.4.1.2 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		
	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（2022年6月30日）	上年度末（2021年12月31日）
分析	市场利率下降 25 个基点	15,411,495.23	3,092,274.48
	市场利率上升 25 个基点	-15,411,495.23	-3,092,274.48

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金投资于固定收益类品种，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对本基金资产净值无重大影响。

### 6.4.14 公允价值

#### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

#### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	-	-
第二层次	3,626,860,703.55	985,709,352.50
第三层次	-	-
合计	3,626,860,703.55	985,709,352.50

#### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券，若不存在活跃市场未经调整的报价（包括重大事项、新发未上市等原因所致），本基金不会将此类证券的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策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。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,626,860,703.55	98.32
	其中：债券	3,626,860,703.55	98.32
	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	10,002,739.73	0.27

	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	26,096,324.43	0.71
8	其他各项资产	25,970,651.20	0.70
9	合计	3,688,930,418.91	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有境内投资股票。

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期内未进行股票投资。

### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期内未进行股票投资。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未进行股票投资。

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	423,339,244.43	11.81
2	央行票据	-	-
3	金融债券	540,482,416.54	15.08
	其中：政策性金融债	20,103,868.49	0.56
4	企业债券	803,908,769.03	22.44
5	企业短期融资券	222,705,306.86	6.22
6	中期票据	1,626,437,159.00	45.39
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	9,987,807.69	0.28
9	其他	-	-
10	合计	3,626,860,703.55	101.22

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	220007	22 付息国债 07	2,000,000	199,706,356.16	5.57
2	102103181	21 河钢集 MTN007	1,000,000	104,200,164.38	2.91
3	155100	18 海纾困	1,000,000	103,318,498.63	2.88
4	019664	21 国债 16	1,000,000	101,646,219.18	2.84
5	155656	19 保利 01	950,000	97,314,954.79	2.72

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 7.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未投资国债期货。

##### 7.10.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

#### 7.11 投资组合报告附注

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

###### 一、21 邮储银行二级 01:

2021 年 7 月 5 日，银保监罚决字（2021）23 号显示，中国邮政储蓄银行股份有限公司存在违规向部分客户收取唯一账户年费和小额账户管理费等 6 项违法违规事实，被处罚没 449.08 万元。2021 年 8 月 20 日，银罚字（2021）16 号显示，中国邮政储蓄银行股份有限公司存在违反账户管理相关规定的违法违规事实，被处警告，并处罚款 600 万元。2022 年 3 月 25 日，银保监罚决字（2022）16 号显示，中国邮政储蓄银行股份有限公司存在逾期 90 天以上贷款余额 EAST 数据存在偏差等 13 项违法违规事实，被处罚款 290 万元。对以上事件，本基金判断，中国邮政储蓄银行股份有限公司经营稳健，上述处罚对公司影响可控。后续关注其制度建设与执行等公司基础性建设问题的合规性以及企业的经营状况。

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

### 7.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金本报告期末未持有股票。

### 7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	125,475.05
2	应收清算款	9,572,678.61
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	16,272,497.54
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	25,970,651.20

### 7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

### 7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金 份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总 份额 比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)
长盛安逸 纯债 A	41,694	34,671.94	737,377,772.09	51.01	708,234,126.17	48.99
长盛安逸 纯债 C	63,291	8,262.15	169,381.60	0.03	522,750,359.21	99.97
长盛安逸 纯债 D	-	-	-	-	-	-
长盛安逸 纯债 E	13,962	88,758.34	549,593,376.16	44.35	689,650,612.68	55.65

合计	118,947	26,968.11	1,287,140,529.85	40.13	1,920,635,098.06	59.87
----	---------	-----------	------------------	-------	------------------	-------

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计数（即期末基金份额总额），户均持有的基金份额的合计计数=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	长盛安逸纯债 A	808,408.75	0.0559
	长盛安逸纯债 C	90,641.62	0.0173
	长盛安逸纯债 D	0.00	0.0000
	长盛安逸纯债 E	2,594,447.05	0.2094
	合计	3,493,497.42	0.1089

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计数。

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	长盛安逸纯债 A	0
	长盛安逸纯债 C	0~10
	长盛安逸纯债 D	0
	长盛安逸纯债 E	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	长盛安逸纯债 A	0
	长盛安逸纯债 C	0
	长盛安逸纯债 D	0
	长盛安逸纯债 E	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	长盛安逸纯债 A	长盛安逸纯债 C	长盛安逸纯债 D	长盛安逸纯债 E
基金合同生效日 (2020年1月20日) 基金份额	188,311,269.29	63,712,497.27	-	-



总额				
本报告期 期初基金 份额总额	640,098,578.35	201,282,653.53	-	-
本报告期 基金总申 购份额	1,048,217,695.38	642,829,423.94	-	1,254,123,621.38
减：本报告 期基金总 赎回份额	242,704,375.47	321,192,336.66	-	14,879,632.54
本报告期 基金拆分 变动份额	-	-	-	-
本报告期 期末基金 份额总额	1,445,611,898.26	522,919,740.81	-	1,239,243,988.84

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### 10.2.1 本基金管理人的高级管理人员重大人事变动情况

自 2022 年 4 月 1 日起实施的《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》明确将公司财务负责人纳入高级管理人员序列。本报告期内，公司按照法规规定完成了公司财务负责人刁俊东同志在监管机构的任职备案，以及在中国证券投资基金业协会的登记。

#### 10.2.2 基金经理变动情况

本报告期本基金基金经理未曾变动。

#### 10.2.3 本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动情况

本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略没有改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的会计师事务所为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），本报告期内本基金未更换会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
安信证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-

#### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
安信证券	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
光大证券	53,815,074.09	5.67	-	-	-	-
国金证券	45,266,918.70	4.77	341,000,000.00	3.97	-	-
华创证券	849,338,056.58	89.55	8,240,000,000.00	96.03	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-

注：1、本公司选择证券经营机构的标准

(1) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时为本公司提供高质量的咨询

服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告等，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

(2) 资力雄厚，信誉良好。

(3) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定。

(4) 经营行为规范，最近两年未因重大违规行为而受到中国证监会和中国人民银行处罚。

(5) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求。

(6) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本公司基金进行证券交易的需要，并能为本公司基金提供全面的信息服务。

## 2、本公司租用券商交易单元的程序

(1) 研究机构提出服务意向，并提供相关研究报告；

(2) 研究机构的研究报告需要有一定的试用期，试用期视服务情况和研究服务评价结果而定；

(3) 研究、投资管理等部门试用研究机构的研究报告后，按照研究服务评价规定，对研究机构进行综合评价；

(4) 试用期满后，评价结果符合条件，双方认为有必要继续合作，经公司领导审批后，我司与研究机构签定《研究服务协议》《券商交易单元租用协议》，并办理基金专用交易单元租用手续。评价结果如不符合条件则终止试用；

(5) 本公司每两个月对签约机构的服务进行一次综合评价。经过评价，若本公司认为签约机构的服务不能满足要求，或签约机构违规受到国家有关部门的处罚，本公司有权终止签署的协议，并撤销租用的交易单元；

(6) 交易单元租用协议期限为一年，到期后若双方没有异议可自动延期一年。

## 3、本基金租用证券公司交易单元为共用交易单元。

## 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：

序号	证券公司名称	交易单元所属市场	数量
1	长江证券	北京	1

(2) 本基金报告期内停止租用交易单元情况：无。

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	长盛基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具准则的公告	中国证监会指定披露媒介	2022 年 1 月 1 日

2	长盛基金管理有限公司关于终止部分基金销售机构办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会指定披露媒介	2022 年 1 月 1 日
3	长盛基金管理有限公司关于增加东方财富证券为旗下部分开放式基金代销机构及开通基金定投、转换及费率优惠业务的公告	中国证监会指定披露媒介	2022 年 1 月 14 日
4	长盛基金管理有限公司旗下全部基金 2021 年 4 季度报告提示性公告	中国证监会指定披露媒介	2022 年 1 月 22 日
5	长盛安逸纯债债券型证券投资基金 2021 年第 4 季度报告	中国证监会指定披露媒介	2022 年 1 月 22 日
6	长盛基金管理有限公司关于增加长盛安逸纯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	2022 年 1 月 24 日
7	长盛安逸纯债债券型证券投资基金暂停大额申购、转换转入、定期定额投资业务的公告	中国证监会指定披露媒介	2022 年 1 月 26 日
8	长盛基金管理有限公司关于旗下部分基金增加宁波银行同业易管家平台为代销机构的公告	中国证监会指定披露媒介	2022 年 1 月 27 日
9	长盛安逸纯债债券型证券投资基金暂停大额申购、转换转入、定期定额投资业务的公告	中国证监会指定披露媒介	2022 年 3 月 9 日
10	关于长盛安逸纯债债券型证券投资基金增加 E 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	2022 年 3 月 18 日
11	长盛安逸纯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	2022 年 3 月 18 日
12	长盛安逸纯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	2022 年 3 月 18 日
13	长盛安逸纯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	2022 年 3 月 18 日
14	长盛基金管理有限公司关于旗下基金增加攀赢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	2022 年 3 月 23 日
15	长盛基金管理有限公司关于旗下基金参加广发证券费率优惠活动的公告	中国证监会指定披露媒介	2022 年 3 月 25 日
16	长盛基金管理有限公司旗下全部基金 2021 年年度报告提示性公告	中国证监会指定披露媒介	2022 年 3 月 31 日
17	长盛安逸纯债债券型证券投资基金 2021 年年度报告	中国证监会指定披露媒介	2022 年 3 月 31 日
18	长盛基金管理有限公司关于增加德邦证券为旗下部分开放式基金代销机构	中国证监会指定披露媒介	2022 年 4 月 21 日

	及开通基金定投业务的公告		
19	长盛安逸纯债债券型证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	中国证监会指定披露媒 介	2022 年 4 月 22 日
20	长盛基金管理有限公司旗下全部基金 2022 年 1 季度报告提示性公告	中国证监会指定披露媒 介	2022 年 4 月 22 日
21	长盛安逸纯债债券型证券投资基金调 整暂停大额申购、转换转入、定期定 额投资业务金额的公告	中国证监会指定披露媒 介	2022 年 4 月 26 日
22	长盛安逸纯债债券型证券投资基金调 整暂停大额申购、转换转入、定期定 额投资业务金额的公告	中国证监会指定披露媒 介	2022 年 5 月 16 日
23	长盛基金管理有限公司关于旗下部分 基金增加销售机构的公告	中国证监会指定披露媒 介	2022 年 5 月 23 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	2022 年 5 月 31 日
25	长盛基金管理有限公司关于旗下基金 增加招商银行股份有限公司为代销机 构的公告	中国证监会指定披露媒 介	2022 年 6 月 9 日
26	长盛基金管理有限公司关于旗下基金 增加陆享基金等三家基金销售公司并 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	2022 年 6 月 13 日
27	长盛基金管理有限公司关于旗下基金 参加华安证券费率优惠活动的公告	中国证监会指定披露媒 介	2022 年 6 月 20 日
28	长盛基金管理有限公司关于旗下基金 参加申万宏源证券有限公司、申万宏 源西部证券有限公司费率优惠活动的 公告	中国证监会指定披露媒 介	2022 年 6 月 22 日
29	长盛基金管理有限公司关于增加天风 证券为旗下部分开放式基金代销机构 的公告	中国证监会指定披露媒 介	2022 年 6 月 23 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期内无影响投资者决策的其他重要信息。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、长盛安逸纯债债券型证券投资基金相关批准文件；
- 2、《长盛安逸纯债债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长盛安逸纯债债券型证券投资基金托管协议》；
- 4、《长盛安逸纯债债券型证券投资基金招募说明书》；
- 5、法律意见书；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照。

### 12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公地址和/或基金托管人的住所。

### 12.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人长盛基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-888-2666、010-86497888。

网址：<http://www.csfunds.com.cn>。

长盛基金管理有限公司

2022 年 8 月 27 日