

# 长盛盛康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：交通银行股份有限公司

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。

基金托管人交通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。

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>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>14</b>
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	19
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>41</b>
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
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	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	41
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	42
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	42
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	42

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 .....	42
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	42
7.11 投资组合报告附注 .....	43
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>45</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	45
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	46
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 .....	46
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>46</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>47</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	47
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 .....	47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	47
10.4 基金投资策略的改变 .....	47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	47
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 .....	48
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	48
10.8 其他重大事件 .....	49
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>50</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 .....	50
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	50
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>50</b>
12.1 备查文件目录 .....	50
12.2 存放地点 .....	51
12.3 查阅方式 .....	51

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	长盛盛康纯债债券型证券投资基金		
基金简称	长盛盛康纯债		
基金主代码	003922		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2018 年 12 月 20 日		
基金管理人	长盛基金管理有限公司		
基金托管人	交通银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	660,018,331.35 份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	长盛盛康纯债 A	长盛盛康纯债 C	长盛盛康纯债 D
下属分级基金的交易代码	003922	003923	013468
报告期末下属分级基金的份额总额	656,915,203.87 份	3,103,127.48 份	0.00 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在控制风险和保持资产流动性的基础上，追求基金资产的长期稳健增值，并力争获得超过业绩比较基准的投资业绩。
投资策略	<p>(一) 大类资产配置策略</p> <p>本基金将在综合判断宏观经济周期、市场资金供需状况、大类资产估值水平对比的基础上，结合政策分析，确定不同投资期限内的大类金融资产配置和债券类属配置。同时通过严格风险评估，及时调整资产组合比例，保持资产配置风险、收益平衡，以稳健提升投资组合回报。</p> <p>(二) 债券组合管理策略</p> <p>本基金债券组合管理策略包含：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。</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	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张利宁
	联系电话	010-86497608
	电子邮箱	zhangln@csfunds.com.cn
客户服务电话	400-888-2666、010-86497888	95559

传真	010-86497999	021-62701216
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	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 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	中国（上海）长宁区仙霞路 18 号
邮政编码	100029	200336
法定代表人	高民和	任德奇

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金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
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)		
	长盛盛康纯债 A	长盛盛康纯债 C	长盛盛康纯债 D
本期已实现收益	9,622,582.99	26,079.32	344,682.85
本期利润	12,896,431.44	10,575.62	312,820.40
加权平均基金份额本期利润	0.0262	0.0075	0.0099
本期加权平均净值利润率	2.41%	0.69%	0.92%
本期基金份额净值增长率	2.14%	2.08%	2.14%
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	17,035,036.40	28,774.81	-
期末可供分配基金份额利润	0.0259	0.0093	-
期末基金资产净值	719,503,458.27	3,363,080.86	-
期末基金份额净值	1.0953	1.0838	1.0953
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	9.45%	8.31%	3.66%

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、长盛盛康纯债债券型证券投资基金由长盛盛康灵活配置混合型证券投资基金转型而来，转型日期为 2018 年 12 月 20 日（即基金合同生效日）。

5、本基金自 2021 年 9 月 2 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。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

长盛盛康纯债 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
过去一个月	0.06%	0.04%	-0.24%	0.03%	0.30%	0.01%
过去三个月	1.44%	0.04%	0.29%	0.04%	1.15%	0.00%
过去六个月	2.14%	0.06%	0.38%	0.05%	1.76%	0.01%
过去一年	4.28%	0.04%	1.83%	0.05%	2.45%	-0.01%
过去三年	8.16%	0.10%	3.53%	0.06%	4.63%	0.04%
自基金转型起至今	9.45%	0.10%	4.21%	0.06%	5.24%	0.04%

长盛盛康纯债 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	0.06%	0.04%	-0.24%	0.03%	0.30%	0.01%
过去三个月	1.41%	0.04%	0.29%	0.04%	1.12%	0.00%
过去六个月	2.08%	0.06%	0.38%	0.05%	1.70%	0.01%
过去一年	4.23%	0.04%	1.83%	0.05%	2.40%	-0.01%
过去三年	7.69%	0.10%	3.53%	0.06%	4.16%	0.04%
自基金转型起至今	8.31%	0.35%	4.21%	0.06%	4.10%	0.29%

## 长盛盛康纯债 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	0.06%	0.04%	-0.24%	0.03%	0.30%	0.01%
过去三个月	1.44%	0.04%	0.29%	0.04%	1.15%	0.00%
过去六个月	2.14%	0.06%	0.38%	0.05%	1.76%	0.01%
自基金新增本类份额起至今	3.66%	0.05%	0.76%	0.05%	2.90%	0.00%

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

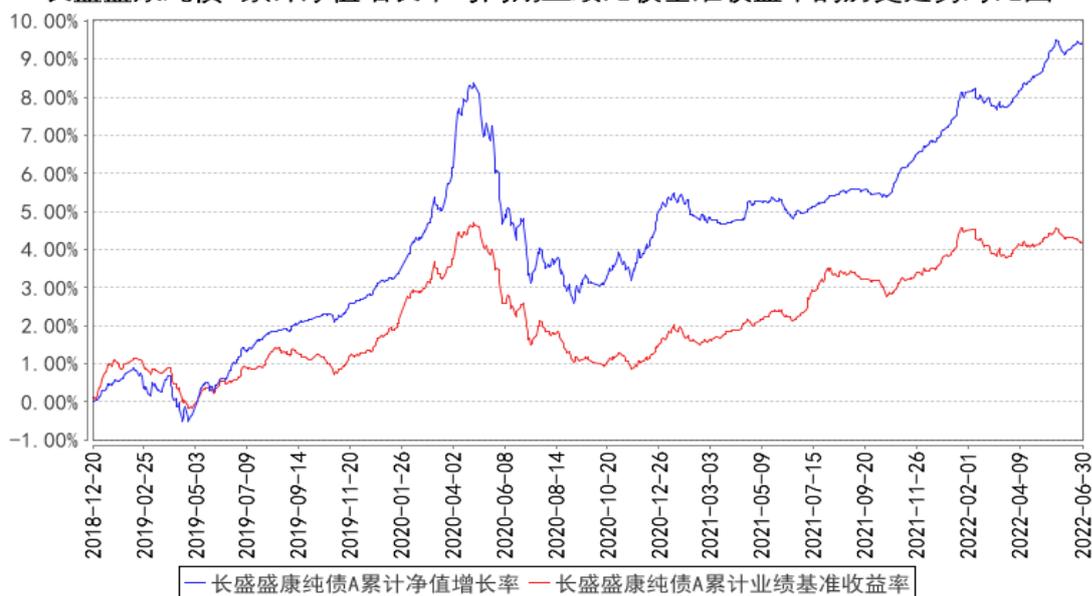
中债综合指数（全价）由中央国债登记结算有限责任公司编制并发布，该指数样本具有广泛的市场代表性，涵盖了主要交易市场（银行间市场、交易所市场等）、不同发行主体（政府、企业等）和期限（长期、中期、短期等）。

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

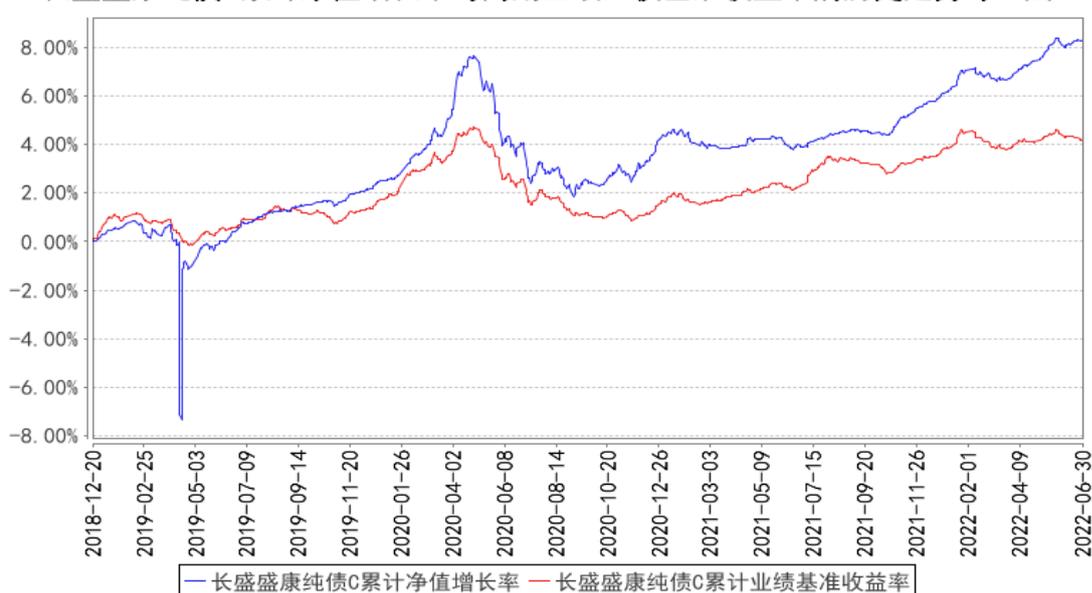
债的纯债部分。鉴于中债综合指数(全价)能够反映债券全市场的整体价格和投资回报情况，所以以其收益率作为本基金的业绩比较基准。

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

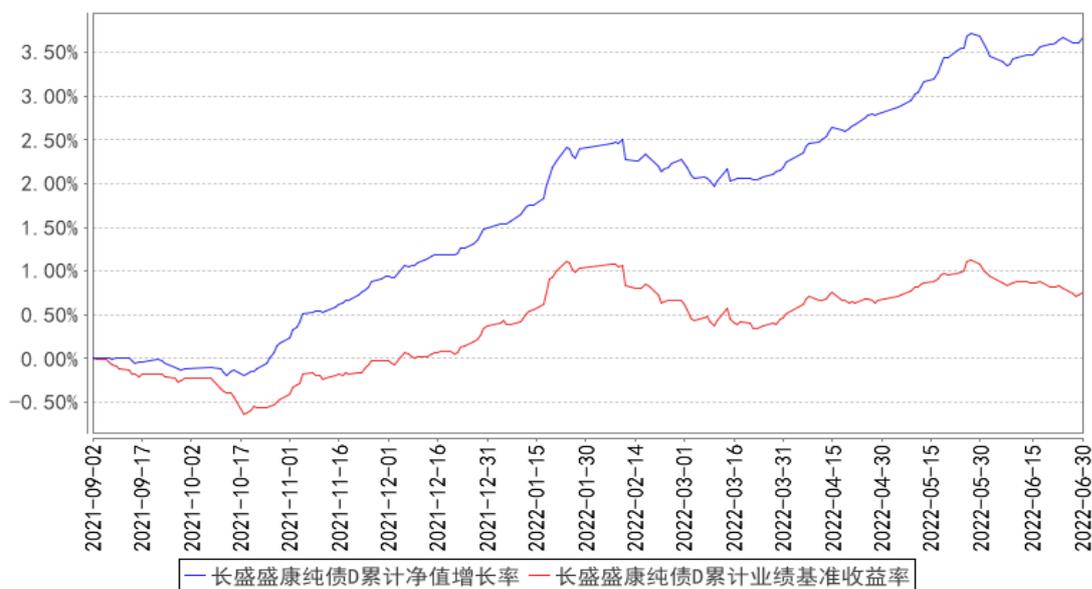
长盛盛康纯债A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



长盛盛康纯债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



长盛盛康纯债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



注：1、长盛盛康纯债债券型证券投资基金由长盛盛康灵活配置混合型证券投资基金转型而来，转型日期为 2018 年 12 月 20 日（即基金合同生效日）。

2、按照本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。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	职务	任本基金的基金经理（助理）期限	证券从	说明
---	----	-----------------	-----	----

名		任职日期	离任日期	业年限	
李琪	本基金基金经理，长盛盛辉混合型证券投资基金基金经理，长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛信息安全量化策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛量化多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理。	2019年11月25日	-	17年	李琪先生，博士。历任大公国际资信评估有限公司信用分析师、信用评审委员会委员，泰康资产管理有限责任公司信用研究员。2011年3月加入长盛基金管理有限公司，曾任信用研究员、基金经理助理等职务。

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，利率债总体呈窄幅震荡走势。年初至 1 月下旬，降息和经济悲观预期推动债券收益率下行，10 年期国债收益率向下突破 2.7%。随后，1 月金融数据高增明显推升稳增长预期、多地楼市调控政策放松、1-2 月经济数据超预期等多重利空因素带动债市回调，10 年期国债收益率一度上行至 2.85%。3 月下旬至 4 月上旬，上海疫情蔓延，经济担忧加剧，货币政策宽松预期升温，利率重回下行。4 月中旬至 4 月底，央行降准幅度不及预期，人民币贬值幅度加大，美债利率急速攀升，利率再度走升。同时资金利率大幅下行，带动短端利率走低，曲线呈现陡峭化。5 月，资金面维持宽松，4 月社融数据偏弱叠加经济数据加速下行，北京出现局部疫情，全国稳住经济大盘会议强调经济下行压力，多重利多因素推动利率下行。5 月底以来，上海复工复产，经济修复改善，利率再度回升。信用债表现明显好于利率债，在资金持续宽松下，信用利差和等级利差均有所收窄。

#### 2、报告期内本基金投资策略分析

报告期内，本基金主要配置中高等级和中短久期信用债，择时参与利率债波段交易。根据经济、政策和市场变化，适时调整组合久期和仓位，以实现组合收益的稳健增长。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末长盛盛康纯债 A 的基金份额净值为 1.0953 元，本报告期基金份额净值增长率

为 2.14%，同期业绩比较基准收益率为 0.38%；截至本报告期末长盛盛康纯债 C 的基金份额净值为 1.0838 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.08%，同期业绩比较基准收益率为 0.38%；截至本报告期末长盛盛康纯债 D 的基金份额净值为 1.0953 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.14%，同期业绩比较基准收益率为 0.38%。

#### 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，随着国内疫情负面冲击逐步消退，扩内需和稳增长政策落地起效，经济回升动力增强。但在疫情发展形势不确定和坚持常态化防控措施下，供应链产业链稳定性和顺畅度、市场微观主体经营信心、经济运行效率等方面或会受到扰动。此外，在受到连续冲击以及房住不炒主基调下，整体地产产业链的修复可能需要更长时间。在这种环境下，国内债市大概率呈现震荡格局，策略上注重组合久期和仓位的灵活应对。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

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

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

估值数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

本基金截至 2022 年 6 月 30 日，期末可供分配利润为 17,063,811.21 元，其中：长盛盛康纯债 A 期末可供分配利润为 17,035,036.40 元（长盛盛康纯债 A 的未分配利润已实现部分为 17,035,036.40 元，未分配利润未实现部分为 45,553,218.00 元），长盛盛康纯债 C 期末可供分配利润为 28,774.81 元（长盛盛康纯债 C 的未分配利润已实现部分为 28,774.81 元，未分配利润未实现部分为 231,178.57 元），长盛盛康纯债 D 期末可供分配利润为 0 元（长盛盛康纯债 D 的未分配利润已实现部分为 0 元，未分配利润未实现部分为 0 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，基金托管人在长盛盛康纯债债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

### 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，长盛基金管理有限公司在长盛盛康纯债债券型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配，符合基金合同的规定。

### 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

本报告期内，由长盛基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关长盛盛康纯债债券型证券投资基金的报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：长盛盛康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	112,671.31	267,311.07
结算备付金		4,184,035.45	1,792,791.68
存出保证金		9,232.70	5,632.58
交易性金融资产	6.4.7.2	957,885,179.18	406,964,665.90
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		947,564,499.73	396,954,665.90
资产支持证券投资		10,320,679.45	10,010,000.00
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
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		496,107.54	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	221.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	7,436,785.15
资产总计		962,687,226.18	416,467,407.38
<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		238,971,942.43	108,649,481.42
应付清算款		-	115,650.58
应付赎回款		456,371.68	-
应付管理人报酬		178,201.99	78,050.56
应付托管费		47,520.51	20,813.49
应付销售服务费		338.18	57.88
应付投资顾问费		-	-
应交税费		50,427.94	27,819.47

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	115,884.32	113,122.01
负债合计		239,820,687.05	109,004,995.41
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	660,018,331.35	286,731,390.86
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	62,848,207.78	20,731,021.11
净资产合计		722,866,539.13	307,462,411.97
负债和净资产总计		962,687,226.18	416,467,407.38

注：1、报告截止日 2022 年 06 月 30 日，长盛盛康纯债 A 的基金份额净值为 1.0953 元，份额总额为 656,915,203.87 份；长盛盛康纯债 C 的基金份额净值为 1.0838 元，份额总额为 3,103,127.48 份；长盛盛康纯债 D 的基金份额净值为 1.0953 元，份额总额为 0.00 份。基金份额总额 660,018,331.35 份。

2、以下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：长盛盛康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 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
<b>一、营业总收入</b>		15,851,561.18	147,390.32
1. 利息收入		337,148.25	100,237.57
其中：存款利息收入	6.4.7.9	64,781.99	2,948.43
债券利息收入		-	94,814.03
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		272,366.26	2,475.11
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		12,287,089.56	42,367.37
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	12,140,729.94	42,367.37

资产支持证券投资收益	6. 4. 7. 12	146, 359. 62	-
贵金属投资收益	6. 4. 7. 13	-	-
衍生工具收益	6. 4. 7. 14	-	-
股利收益	6. 4. 7. 15	-	-
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. 16	3, 226, 482. 30	4, 690. 93
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. 17	841. 07	94. 45
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>2, 631, 733. 72</b>	<b>47, 745. 92</b>
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	838, 440. 08	15, 411. 44
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	223, 584. 03	4, 109. 67
3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	745. 32	515. 16
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		1, 419, 974. 23	531. 16
其中：卖出回购金融资产支出		1, 419, 974. 23	531. 16
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		29, 426. 77	-
8. 其他费用	6. 4. 7. 18	119, 563. 29	27, 178. 49
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>13, 219, 827. 46</b>	<b>99, 644. 40</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>13, 219, 827. 46</b>	<b>99, 644. 40</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>	<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>13, 219, 827. 46</b>	<b>99, 644. 40</b>

注：以下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：长盛盛康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	未分配利润	净资产合计

		合收益		
一、上期期末净资产（基金净值）	286,731,390.86	-	20,731,021.11	307,462,411.97
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）	286,731,390.86	-	20,731,021.11	307,462,411.97
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	373,286,940.49	-	42,117,186.67	415,404,127.16
（一）、综合收益总额	-	-	13,219,827.46	13,219,827.46
（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）	373,286,940.49	-	28,897,359.21	402,184,299.70
其中：1. 基金申购款	1,036,542,646.66	-	81,129,598.34	1,117,672,245.00
2. 基金赎回款	-663,255,706.17	-	-52,232,239.13	-715,487,945.30
（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）	660,018,331.35	-	62,848,207.78	722,866,539.13
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）	2,390,633.20	-	110,960.72	2,501,593.92
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）	2,390,633.20	-	110,960.72	2,501,593.92
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	573,971,783.10	-	26,408,453.61	600,380,236.71
（一）、综合收益总额	-	-	99,644.40	99,644.40
（二）、本期基金份额交易	573,971,783.10	-	26,308,809.21	600,280,592.31

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	625,734,952.62	-	28,830,820.54	654,565,773.16
2. 基金赎回款	-51,763,169.52	-	-2,522,011.33	-54,285,180.85
(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)	576,362,416.30	-	26,519,414.33	602,881,830.63

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

刁俊东

龚珉

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

长盛盛康纯债债券型证券投资基金(原名为“长盛盛康灵活配置混合型证券投资基金”，以下简称“本基金”)由长盛盛康灵活配置混合型证券投资基金转型而来。根据长盛基金管理有限公司 2018 年 12 月 21 日发布的《长盛盛康灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，原长盛盛康灵活配置混合型证券投资基金自 2018 年 12 月 20 日起转型为本基金。原《长盛盛康灵活配置混合型证券投资基金基金合同》自 2018 年 12 月 20 日起失效，修订后的《长盛盛康纯债债券型证券投资基金基金合同》自同日起生效。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定。原长盛盛康灵活配置混合型证券投资基金于基金合同失效前经审计的基金资产净值为 52,596,897.30 元，已于本基金的基金合同生效日全部转为本基金的基金资产净值。本基金的基金管理人为长盛基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《关于长盛盛康纯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》以及更新的《长盛盛康纯债债券型证券投资基金基金合同》，自 2021 年 9 月 2 日起，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，各类基金份额分别计算基金份额净值。投

资人可自由选择申购某一类别的基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛盛康纯债债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为固定收益类金融工具，具体包括：国债、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债、分离交易可转债的纯债部分、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、中小企业私募债等债券，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，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、权证等权益类资产。本基金投资组合中债券投资占基金资产的比例不低于 80%；在每个交易日日终，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。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

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《长盛盛康纯债债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止期间的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 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资产变动情况等有关信息。

#### 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

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。除下述会计政策外，本基金本报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

##### 6.4.4.1 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

##### (1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

#### 债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

##### 以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

##### 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。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和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

#### 权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

#### (2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债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。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### (3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/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

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于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，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金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；或者(3) 该金融资产已转移，虽然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，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 6.4.4.3 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息后的净额确认为公允价值变动损益;于处置时,其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及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投资收益,其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

### 6.4.5 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

财政部于 2017 年颁布了修订后的《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》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”),财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》,公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外,中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《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>》,本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金 2022 年度财务报表,对本基金财务报表的影响列示如下:

##### (a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定,本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额,2021 年度的比较财务报表未重列。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日,本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

于 2022 年 1 月 1 日,本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下:

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收利息和应收申购款,金额分别为 267,311.07 元、1,792,791.68 元、5,632.58 元、7,436,785.15 元和 221.00 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保

证金、其他资产-应收利息和应收申购款，金额分别为 267,546.34 元、1,793,598.48 元、5,635.08 元、0.00 元和 221.00 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 406,964,665.90 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 414,400,406.48 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产款、应付证券清算款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、应付交易费用和应付利息，金额分别为 108,649,481.42 元、115,650.58 元、78,050.56 元、20,813.49 元、57.88 元、16,888.13 元和 37,233.88 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产款、应付清算款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、其他负债-应付交易费用和其他负债-应付利息，金额分别为 108,686,715.30 元、115,650.58 元、78,050.56 元、20,813.49 元、57.88 元、16,888.13 元和 0.00 元。

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日，本基金根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示，无期初留存收益影响。

(b) 修订后的《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>》

根据中国证监会于 2022 年颁布的修订后的《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>》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

#### 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

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《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》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税

[2016]140 号《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》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。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，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 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	112,671.31
等于：本金	112,408.48
加：应计利息	262.83
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	112,671.31

#### 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	354,641,799.62	5,102,091.09	361,839,088.09	2,095,197.38
	银行间市场	573,159,559.64	9,581,611.64	585,725,411.64	2,984,240.36
	合计	927,801,359.26	14,683,702.73	947,564,499.73	5,079,437.74
资产支持证券	9,925,515.07	280,679.45	10,320,679.45	114,484.93	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	937,726,874.33	14,964,382.18	957,885,179.18	5,193,922.67	

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

#### 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

无余额。

##### 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

无余额。

#### 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	7.88
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	17,616.29
其中：交易所市场	-
银行间市场	17,616.29

应付利息	-
预提费用	98,260.15
合计	115,884.32

## 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

## 长盛盛康纯债 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	286,017,353.93	286,017,353.93
本期申购	371,225,590.13	371,225,590.13
本期赎回（以“-”号填列）	-327,740.19	-327,740.19
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	656,915,203.87	656,915,203.87

## 长盛盛康纯债 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	714,036.93	714,036.93
本期申购	6,870,643.81	6,870,643.81
本期赎回（以“-”号填列）	-4,481,553.26	-4,481,553.26
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	3,103,127.48	3,103,127.48

## 长盛盛康纯债 D

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	-	-
本期申购	658,446,412.72	658,446,412.72
本期赎回（以“-”号填列）	-658,446,412.72	-658,446,412.72
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	-	-

注：申购含转换入；赎回含转换出。

## 6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

长盛盛康纯债 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	1,893,565.76	18,793,418.88	20,686,984.64
本期利润	9,622,582.99	3,273,848.45	12,896,431.44
本期基金份额交易产生的变动数	5,518,887.65	23,485,950.67	29,004,838.32
其中：基金申购款	5,524,422.61	23,507,942.25	29,032,364.86
基金赎回款	-5,534.96	-21,991.58	-27,526.54
本期已分配利润	-	-	-
本期末	17,035,036.40	45,553,218.00	62,588,254.40

长盛盛康纯债 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-6,586.49	50,622.96	44,036.47
本期利润	26,079.32	-15,503.70	10,575.62
本期基金份额交易产生的变动数	9,281.98	196,059.31	205,341.29
其中：基金申购款	29,922.84	526,723.36	556,646.20
基金赎回款	-20,640.86	-330,664.05	-351,304.91
本期已分配利润	-	-	-
本期末	28,774.81	231,178.57	259,953.38

长盛盛康纯债 D

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	344,682.85	-31,862.45	312,820.40
本期基金份额交易产生的变动数	-344,682.85	31,862.45	-312,820.40
其中：基金申购款	9,647,611.71	41,892,975.57	51,540,587.28
基金赎回款	-9,992,294.56	-41,861,113.12	-51,853,407.68
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-	-	-

## 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		39,043.67
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		25,695.02
其他		43.30
合计		64,781.99

**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	11,991,086.15
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	149,643.79
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	12,140,729.94

**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	323,515,392.86
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	320,249,977.28
减：应计利息总额	3,105,060.97
减：交易费用	10,710.82
买卖债券差价收入	149,643.79

**6.4.7.12 资产支持证券投资收益****6.4.7.12.1 资产支持证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
资产支持证券投资收益——利息收入	146,359.62
资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入	-
资产支持证券投资收益——赎回差价收入	-
资产支持证券投资收益——申购差价收入	-
合计	146,359.62

**6.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入**

无。

**6.4.7.13 贵金属投资收益**

无。

**6.4.7.14 衍生工具收益**

无。

**6.4.7.15 股利收益**

无。

**6.4.7.16 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	3,226,482.30
股票投资	-
债券投资	3,196,482.30
资产支持证券投资	30,000.00
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	3,226,482.30

**6.4.7.17 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	816.01
基金转换费收入	25.06
合计	841.07

注：1、本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2、本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

**6.4.7.18 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	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	11,853.14
账户维护费	17,850.00

其他	600.00
合计	119,563.29

#### 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

无。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本报告期内，未存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

###### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 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	838,440.08	15,411.44
其中：支付销售机构的客户维护费	1,244.16	322.10

注：支付基金管理人长盛基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.30% 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：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.30% / 当年天数。

###### 6.4.10.2.2 基金托管费

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托管费	223,584.03	4,109.67
----------------	------------	----------

注：支付基金托管人交通银行的托管费按前一日基金资产净值 0.08%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：

日托管费=前一日基金资产净值×0.08%/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			
	长盛盛康纯债 A	长盛盛康纯债 C	长盛盛康纯债 D	合计
长盛基金公司	-	0.31	-	0.31
交通银行	-	27.53	-	27.53
合计	-	27.84	-	27.84
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			
	长盛盛康纯债 A	长盛盛康纯债 C	合计	
长盛基金公司	-	2.99	2.99	
交通银行	-	17.03	17.03	
合计	-	20.02	20.02	

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给长盛基金公司，再由长盛基金公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日销售服务费=前一日 C 类基金份额的基金资产净值×0.10%/当年天数。

#### 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

单位：人民币元

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
交通银行	10,150,356.30	-	-	-	-	-
银行间市场交易的各关联方名称	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出

		出	额			出
交通银行	-	-	-	-	-	-

#### 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
交通银行	112,671.31	39,043.67	222,069,557.44	2,805.60
合计	112,671.31	39,043.67	222,069,557.44	2,805.60

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，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 210,171,942.43 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
180204	18 国开 04	2022 年 7 月 1 日	103.19	300,000	30,958,479.45
2020022	20 南京银行二级 01	2022 年 7 月 1 日	101.54	100,000	10,154,496.99
2028044	20 广发银行二级 01	2022 年 7 月 1 日	106.25	122,000	12,962,606.96
210005	21 付息国债 05	2022 年 7 月 1 日	107.51	29,000	3,117,880.33
210208	21 国开 08	2022 年 7 月 1 日	102.39	300,000	30,716,852.05
210408	21 农发 08	2022 年 7 月 1 日	103.26	100,000	10,326,413.70
2128051	21 工商银行二级 02	2022 年 7 月 1 日	102.18	100,000	10,218,022.47
2228024	22 工商银行二级 03	2022 年 7 月 1 日	101.05	100,000	10,104,835.62
102103363	21 鲁能源 MTN009A(高成长债)	2022 年 7 月 4 日	102.38	200,000	20,475,997.81
102280679	22 鲁能源 MTN003A(可持续挂钩)	2022 年 7 月 4 日	101.73	500,000	50,865,597.26
132100015	21 重庆轨交 GN001	2022 年 7 月 4 日	102.92	100,000	10,291,698.08
132100057	21 重庆轨交 GN004(碳中和债)	2022 年 7 月 4 日	102.07	100,000	10,206,819.18
2028024	20 中信银行二级	2022 年 7 月 4 日	105.69	209,000	22,089,791.77
合计				2,260,000	232,489,491.67

##### 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，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 28,800,000.00 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

本基金是债券型基金，具有中等风险水平的特征，其风险和预期收益低于股票型基金和混合型基金、高于货币市场基金。本基金的投资范围为固定收益类金融工具，具体包括：国债、金融

债、企业债、公司债、次级债、地方政府债、分离交易可转债的纯债部分、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、中小企业私募债等债券，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，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、权证等权益类资产。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金在严格控制风险的前提下满足投资者实现资本增值的投资需求。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制管理委员会为核心的、由风险控制管理委员会、风险控制委员会、监察稽核部与风险管理部、相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部与风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 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、拒绝支付到期本息等情况，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。本基金的银行存款存放在本基金的托管人交通银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，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。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

## 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	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	10,271,068.49	10,067,024.00
合计	10,271,068.49	10,067,024.00

注：未评级部分为国债、政策性金融债、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

无。

## 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
AAA	564,336,448.47	131,940,000.00
AAA 以下	189,563,748.82	128,455,800.00
未评级	183,393,233.95	126,491,841.90
合计	937,293,431.24	386,887,641.90

注：未评级部分为国债、政策性金融债、中期票据、金融债。

## 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

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	10,320,679.45	10,010,000.00
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	10,320,679.45	10,010,000.00

## 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在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。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。

于 2022 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额中有 238,971,942.43 元将在一个月以内到期(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

#### 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在基金运作过程中严格按照《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》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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的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%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易。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投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2022 年 6 月 30 日，本基金无流动性受限资产。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2022 年 6 月 30 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 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

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受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。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

##### 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	112,408.48	-	-	262.83	112,671.31
结算备付金	4,182,341.65	-	-	1,693.80	4,184,035.45
存出保证金	9,229.01	-	-	3.69	9,232.70
交易性金融资产	124,860,420.00	619,175,377.00	198,885,000.00	14,964,382.18	957,885,179.18
应收清算款	-	-	-	496,107.54	496,107.54
资产总计	129,164,399.14	619,175,377.00	198,885,000.00	15,462,450.04	962,687,226.18
负债					
应付赎回款	-	-	-	456,371.68	456,371.68
应付管理人报酬	-	-	-	178,201.99	178,201.99
应付托管费	-	-	-	47,520.51	47,520.51
卖出回购金融资产款	238,923,874.93	-	-	48,067.50	238,971,942.43
应付销售服务费	-	-	-	338.18	338.18
应交税费	-	-	-	50,427.94	50,427.94
其他负债	-	-	-	115,884.32	115,884.32
负债总计	238,923,874.93	-	-	896,812.12	239,820,687.05
利率敏感度缺口	-109,759,475.79	619,175,377.00	198,885,000.00	14,565,637.92	722,866,539.13
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	267,311.07	-	-	-	267,311.07
结算备付金	1,792,791.68	-	-	-	1,792,791.68
存出保证金	5,632.58	-	-	-	5,632.58
交易性金融资产	25,263,310.90	371,596,800.00	10,104,555.00	-	406,964,665.90
应收申购款	-	-	-	221.00	221.00

其他资产	-	-	-	7,436,785.15	7,436,785.15
资产总计	27,329,046.23	371,596,800.00	10,104,555.00	7,437,006.15	416,467,407.38
负债					
卖出回购金融资产款	108,649,481.42	-	-	-	108,649,481.42
应付证券清算款	-	-	-	115,650.58	115,650.58
应付管理人报酬	-	-	-	78,050.56	78,050.56
应付托管费	-	-	-	20,813.49	20,813.49
应付销售服务费	-	-	-	57.88	57.88
应交税费	-	-	-	27,819.47	27,819.47
其他负债	-	-	-	113,122.01	113,122.01
负债总计	108,649,481.42	-	-	355,513.99	109,004,995.41
利率敏感度缺口	-81,320,435.19	371,596,800.00	10,104,555.00	7,081,492.16	307,462,411.97

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予以分类。

#### 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	9,573,342.85	3,724,781.14
	市场利率上升25个基点	-9,573,342.85	-3,724,781.14

#### 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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险的敏感性分析

于2022年6月30日，本基金未持有交易性权益类投资，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于本基金净资产无重大影响（2021年12月31日：同）。

## 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	957,885,179.18	406,964,665.90
第三层次	-	-
合计	957,885,179.18	406,964,665.90

#### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2021 年 12 月 31 日：同)。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

### 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	957,885,179.18	99.50
	其中：债券	947,564,499.73	98.43
	资产支持证券	10,320,679.45	1.07
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	4,296,706.76	0.45
8	其他各项资产	505,340.24	0.05
9	合计	962,687,226.18	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	9,105,236.13	1.26
2	央行票据	-	-
3	金融债券	413,688,569.24	57.23
	其中：政策性金融债	72,074,884.40	9.97
4	企业债券	214,168,809.32	29.63
5	企业短期融资券	10,271,068.49	1.42
6	中期票据	300,330,816.55	41.55
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	947,564,499.73	131.08

### 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	2020044	20 宁波银行二级	600,000	63,876,328.77	8.84
2	188854	21 兴业 C1	500,000	52,116,958.91	7.21
3	102280679	22 鲁能源 MTN003A(可持续挂钩)	500,000	50,865,597.26	7.04
4	102000272	20 乌城投 MTN001	480,000	49,044,971.84	6.78
5	149857	22 东北 01	480,000	48,877,192.77	6.76

### 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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	136356	度小满 5A	100,000	10,320,679.45	1.43

### 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、20 宁波银行二级

2021 年 7 月 21 日，甬银处罚字（2021）2 号显示，宁波银行股份有限公司存在违规为存款人多头开立银行结算账户等 6 项违法违规事实，被处警告，并处罚款 286.2 万元。2021 年 8 月 6 日，甬银保监罚决字（2021）57 号显示，宁波银行股份有限公司存在贷款被挪用于缴纳土地款或土地收储等 6 项违法违规事实，被处罚款 275 万元。2021 年 12 月 31 日，甬银保监罚决字（2021）81 号显示，宁波银行股份有限公司存在信用卡业务管理不到位的违法违规事实，被处罚款 30 万元。2022 年 4 月 18 日，甬银保监罚决字（2022）28 号显示，宁波银行股份有限公司存在信贷资金违规流入房地产领域等违法违规事实，被处罚款 220 万元；甬银保监罚决字（2022）30 号显示，宁波银行股份有限公司存在代理保险销售不规范等违法违规事实，被处罚款 30 万元。2022 年 4 月 23 日，甬银保监罚决字（2022）35 号显示，宁波银行股份有限公司存在薪酬管理不到位等违法违规事实，被处罚款 270 万元。2022 年 5 月 27 日，甬银保监罚决字（2022）44 号显示，宁波银行股份有限公司存在非标投资业务管理不审慎等违法违规事实，被处罚款 290 万元。对以上事件，本基金判断，宁波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。

#### 二、21 兴业 C1

2021 年 10 月，中国证券监督管理委员会福建监管局关于对兴业证券股份有限公司采取出具警示函措施的决定：经查，你公司发布的研究报告《医美行业深度：举重若“轻”，求美有方》存在以下问题：一是研究报告个别内容数据列示错误、文字表述不严谨，未准确标明个别数据出处，就同一数据的列示或预测，你公司同期发布的不同研究报告存在差异。二是存在具体判断或观点论述不够严密的情况，表现为个别具体观点分析依据不充分、以偏概全，个别行业发展趋势的结论基于一家公司的财务数据推论而出、不够严密。三是底稿未记录个别数据的演算方法与过程。上述问题违反了《发布证券研究报告暂行规定（2020 年修订）》（证监会公告（2020）20 号，以下简称《暂行规定》）第三条、第八条第（六）项、第九条、第十八条，以及《证券、期货投资咨询管理暂行办法》（证委发（1997）96 号）第二十五条第一款的相关规定，反映了你公司对该研究报告的质量控制和合规审查不到位。根据《暂行规定》第二十二条的规定，我局决定对你公司采取出具警示函的行政监管措施。你公司应采取切实有效的措施对上述问题进行整改，完善内部控制，重视研究报告质量控制工作，切实提升研究质量和专业服务水平。你公司应于 2021 年 11 月 15 日前向我局提交书面整改报告。对以上事件，本基金判断，兴业证券股份有限公司经营稳健，上述处罚对公司影响可

控，后续持续关注其内部控制和研究报告质量控制工作。

### 三、22 东北 01

2022 年 6 月 29 日，东北证券股份有限公司（以下简称“公司”）收到中国证券监督管理委员会吉林监管局《关于对东北证券股份有限公司采取责令改正措施的决定》（吉证监决[2022]5 号），具体内容如下：

“经查，你公司存在以下行为：一是在部分证券交易单元租用协议未明确约定提供研究成果义务的情况下，将部分证券交易席位租赁收入确认为投资咨询业务收入；二是未在 2021 年年报中披露投资咨询业务收入变动异常的原因。

上述行为不符合《关于证券公司会计核算有关问题的通知》（会计部函[2010]1 号）《证券公司年度报告内容与格式准则》《证券公司监督管理条例》第六十九条和《证券公司内部控制指引》第二十二的规定。根据《证券公司监督管理条例》第七十条的规定，决定对你公司采取责令改正的行政监管措施。你公司应对上述问题予以整改，并于收到本决定之日起 1 个月内向我局提交书面整改报告。对以上事件，本基金判断，东北证券股份有限公司经营稳健，上述处罚对公司影响可控，后续持续关注其内部控制和会计核算相关问题。

### 四、20 广发银行二级 01

2022 年 3 月 25 日，银保监罚决字（2022）23 号显示，广发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 16 项违法违规事实，被处罚款 420 万元。对以上事件，本基金判断，广发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。

### 五、20 中信银行二级

2021 年 11 月 20 日，国家市场监督管理总局国市监处罚（2021）79 号显示，中信银行股份有限公司存在未依法申报违法实施的经营者集中等违法违规事实，被处 50 万元罚款。2022 年 3 月 25 日，银保监罚决字（2022）17 号显示，中信银行股份有限公司存在漏报抵押物价值 EAST 数据等 8 项违法违规事实，被处罚款 290 万元。对以上事件，本基金判断，中信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。

### 六、19 南京银行二级

2021 年 7 月 7 日，国家市场监督管理总局行政处罚决定书国市监处（2021）62 号显示，其于 2021 年 3 月 19 日对南京银行股份有限公司参股设立苏宁消费金融有限公司涉嫌违法实施经营者集中案进行立案调查，经查，该案构成违法实施的经营者集中，但不具有排除、限制竞争的效果，

给予其 50 万元罚款的行政处罚。对以上事件，本基金判断，南京银行股份有限公司经营稳健，上述处罚对公司影响小。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。

### 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	9,232.70
2	应收清算款	496,107.54
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	505,340.24

### 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 (%)
长盛盛康	44	14,929,891.00	656,646,679.48	99.96	268,524.39	0.04

纯债 A						
长盛盛康纯债 C	289	10,737.47	-	-	3,103,127.48	100.00
长盛盛康纯债 D	-	-	-	-	-	-
合计	333	1,982,037.03	656,646,679.48	99.49	3,371,651.87	0.51

注：对于分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对于合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额），户均持有的基金份额的合计数=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	长盛盛康纯债 A	193.89	0.0000
	长盛盛康纯债 C	858.72	0.0277
	长盛盛康纯债 D	0.00	0.0000
	合计	1,052.61	0.0002

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。

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	长盛盛康纯债 A	长盛盛康纯债 C	长盛盛康纯债 D
基金合同生效日（2018年12月20日）基金份额总额	41,635.71	49,732,485.30	-

本报告期期初基金份额总额	286,017,353.93	714,036.93	-
本报告期基金总申购份额	371,225,590.13	6,870,643.81	658,446,412.72
减：本报告期基金总赎回份额	327,740.19	4,481,553.26	658,446,412.72
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	656,915,203.87	3,103,127.48	-

## § 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 基金经理的变动情况

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，徐铁任交通银行资产托管部总经理。

### 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普华永道中天会计师事务所（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、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 (%)	
长江证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	2	-	-	-	-	-

### 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 (%)
长江证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	167,884,020.00	100.00	3,863,497,000.00	100.00	-	-

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
2	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
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	长盛盛康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
5	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
6	长盛盛康纯债债券型证券投资基金恢复大额申购、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17日
7	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
8	长盛盛康纯债债券型证券投资基金	中国证监会指定披露媒介	2022年3月31日

	2021 年年度报告	介	
9	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
10	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
11	长盛盛康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
12	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
13	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
14	长盛基金管理有限公司关于旗下基金增加陆亨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
15	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

## § 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

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	20220101~20220630	285,658,922.11	370,987,757.37	0.00	656,646,679.48	99.49

#### 产品特有风险

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。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期内无影响投资者决策的其他重要信息。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

1、长盛盛康纯债债券型证券投资基金相关批准文件；

- 2、《长盛盛康纯债债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长盛盛康纯债债券型证券投资基金托管协议》；
- 4、《长盛盛康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和/或基金托管人的办公地址。

## 12.3 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 8 月 27 日