

长盛盛启债券型证券投资基金 2023 年中期报告

2023 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：徽商银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 30 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。

基金托管人徽商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 08 月 29 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 2023 年 04 月 11 日（基金合同生效日）起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
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	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
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	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	39
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	40

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	40
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	40
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	40
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	40
7.11 投资组合报告附注	40
§ 8 基金份额持有人信息	41
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	41
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	41
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	42
§ 9 开放式基金份额变动	42
§ 10 重大事件揭示	42
10.1 基金份额持有人大会决议	42
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	42
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	43
10.4 基金投资策略的改变	43
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	43
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	43
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	43
10.8 其他重大事件	45
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	45
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	45
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	46
§ 12 备查文件目录	46
12.1 备查文件目录	46
12.2 存放地点	46
12.3 查阅方式	46

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长盛盛启债券型证券投资基金	
基金简称	长盛盛启债券	
基金主代码	017708	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023 年 4 月 11 日	
基金管理人	长盛基金管理有限公司	
基金托管人	徽商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,998,334,538.38 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	长盛盛启债券 A	长盛盛启债券 C
下属分级基金的交易代码	017708	017709
报告期末下属分级基金的份额总额	1,997,915,728.56 份	418,809.82 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>本基金的债券组合管理策略主要包含利率策略、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，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	徽商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	张利宁	刘国君
	联系电话	010-86497608	0551-65970489
	电子邮箱	zhangln@csfunds.com.cn	liuguojun@hsbank.com.cn
客户服务电话		400-888-2666、010-86497888	40088-96588
传真		010-86497999	0551-65970481

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	安徽省合肥市云谷路 1699 号徽银大厦
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	安徽省合肥市云谷路 1699 号徽银大厦
邮政编码	100029	230000
法定代表人	胡甲	严琛

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券日报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.csfunds.com.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人及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	2023 年 4 月 11 日（基金合同生效日）-2023 年 6 月 30 日	
	长盛盛启债券 A	长盛盛启债券 C
本期已实现收益	10,016,285.39	4,260.28
本期利润	7,329,377.87	3,621.21
加权平均基金份额本期利润	0.0046	0.0025
本期加权平均净值利润率	0.46%	0.25%
本期基金份额净值增长率	0.46%	0.40%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	9,114,067.22	1,688.87
期末可供分配基金份额利润	0.0046	0.0040
期末基金资产净值	2,007,029,795.78	420,498.69
期末基金份额净值	1.0046	1.0040
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	0.46%	0.40%

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、本基金基金合同生效日为 2023 年 4 月 11 日，截至本报告期末本基金成立未满一年。

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

长盛盛启债券 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	0.20%	0.02%	0.18%	0.05%	0.02%	-0.03%
自基金合同生效起至今	0.46%	0.02%	0.90%	0.04%	-0.44%	-0.02%

长盛盛启债券 C

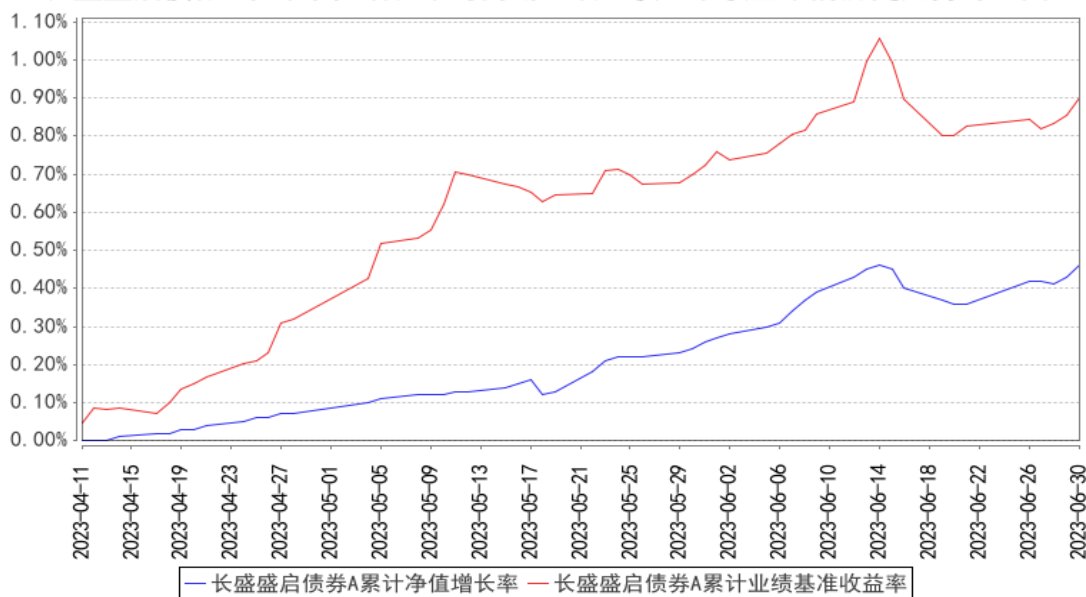
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.18%	0.03%	0.18%	0.05%	0.00%	-0.02%
自基金合同生效起至今	0.40%	0.02%	0.90%	0.04%	-0.50%	-0.02%

注：本基金业绩比较基准为：中债综合指数（全价）收益率

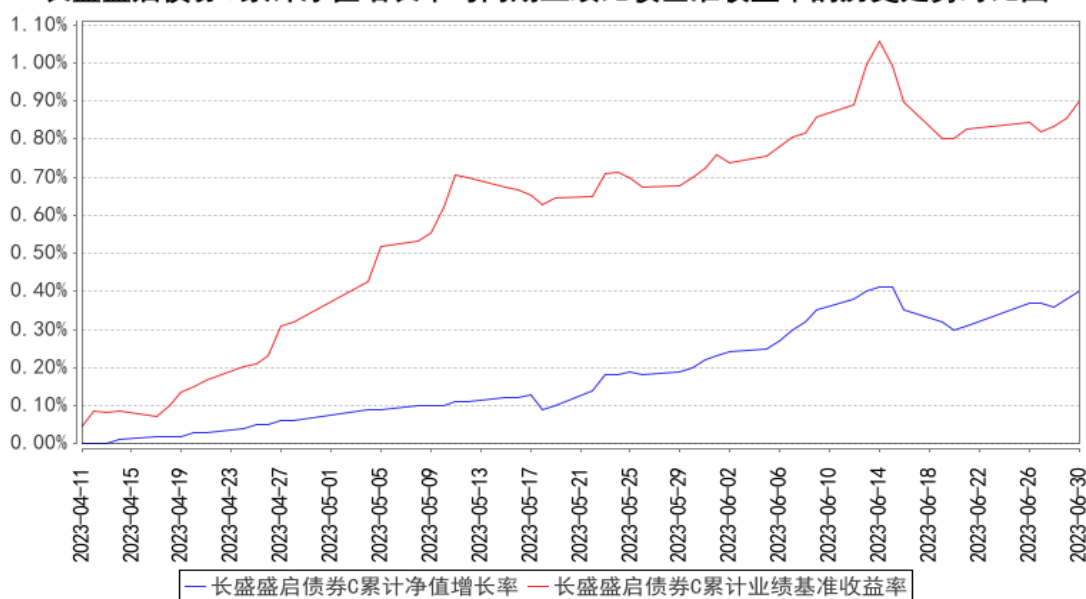
中债综合指数（全价）由中央国债登记结算有限责任公司编制并发布，该指数样本具有广泛的市场代表性，涵盖了主要交易市场（银行间市场、交易所市场等）、不同发行主体（政府、企业等）和期限（长期、中期、短期等）。鉴于中债综合指数（全价）能够反映债券全市场的整体价格和投资回报情况，所以以其收益率作为本基金的业绩比较基准。比较基准每个交易日进行一次再平衡，每个交易日在加入损益后根据设定的权重比例进行大类资产之间的再平衡，使大类资产比例保持恒定。

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

长盛盛启债券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



长盛盛启债券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



注：1、本基金基金合同生效日为 2023 年 04 月 11 日，截至本报告期末本基金成立未满一年。

2、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。截至本报告期末本基金仍处于建仓期。

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%；本基金持有的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。

§ 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（DBS）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 2023 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		
张建	本基金基金经理 长盛安鑫中短债债券型证券投资基金基金经理 长盛恒盛利率债债券型证券投资基金基金经理 长盛盛远债券型证券投资基金基金经理	2023 年 4 月 11 日	-	10 年	张建先生，硕士。曾任中国银河证券股份有限公司交易员/投资助理、银河金汇证券资产管理有限公司投资助理/投资主办人。2021 年 11 月加入长盛基金管理有限公司固定收益部。

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，国内经济增长面临较大的下行压力。消费持续修复，基建托底经济增长，出口、地产和制造业对经济增长形成拖累。此外，物价走低，6 月份 CPI 当月同比 0%，累计同比 0.7%，物

价指数处于低位。6 月份制造业 PMI 仍位于荣枯线下方，显示经济景气度较差。上半年，债券市场表现较好，呈现牛市行情，收益率快速下行，一度触及去年低位。品种上有一定分化，不同券种之间呈现轮动行情。一季度，市场对经济修复预期较强，对政策预期较为充分，市场在“强预期、弱现实”的主线逻辑下运行。同时，资金面稳定性较差，在税期、月末、季末等时点波动较大，且资金价格中枢较高。在此背景下，一季度信用债呈现“看空做多”的格局，表现好于利率债。一方面，经过去年底大幅调整后，信用债具有较好的配置价值；另一方面，随着银行理财、公募基金等理财产品负债端修复，配置需求旺盛，信用债债券收益率一路下行。利率债方面，虽有城商、农商等银行机构持续的配置，收益率依然呈现震荡上行的走势。进入二季度，资金面有所改善，资金价格稳定性增加，价格中枢下移，利好债券市场。同时，高频经济数据显示经济面临较大的下行压力，政策预期减弱，“弱预期、弱现实”成为共识，债市开始快速的上涨行情，尤其长端利率债，收益率快速下行。

上半年，央行通过及时合理的 OMO 操作，足量投放资金，在税期、月末、季末等时点，加大资金投放，平抑资金面波动，呵护债券市场平稳运行。进入六月份，央行先后调降 OMO 利率、常备借贷便利利率、MLF 利率和 LPR 利率，引导资金利率下行，降低银行负债成本，稳定市场预期。

在此背景下，上半年债券市场收益率整体下行，呈现牛市行情。以国开债为例，10 年下行 21.80BP 至 2.7727%，5 年下行 29.89BP 至 2.5323%，1 年下行 13.68BP 至 2.0949%，收益率曲线呈现平坦化趋势。

2、报告期内本基金投资策略分析

报告期内，本基金主要投资于信用债，在久期和杠杆操作上，保持中性偏积极的操作思路，在防范信用风险的前提下根据市场情况不断调整资产结构。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末长盛盛启债券 A 的基金份额净值为 1.0046 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.46%，同期业绩比较基准收益率为 0.90%；截至本报告期末长盛盛启债券 C 的基金份额净值为 1.0040 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.40%，同期业绩比较基准收益率为 0.90%。

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，经济增长压力较大。消费依旧是经济增长的主要抓手，家电下乡、新能源汽车下乡等一定程度上能刺激消费需求，预计下半年将积极扩大国内需求，发挥消费拉动经济增长的基础性作用。地产景气度走弱，“房地产市场供求关系发生重大变化”，地产政策有望适时调整优化，房地产及其相关产业链景气度在一定程度上能得到提升。基建有望进一步发力，城中村改造和“平急两用”基础设施建设将助力经济增长。制造业增速维持高位，但进一步提升空间有限。

欧美等发达国家经济景气度走低，使得出口依旧面临较大下行压力。整体看，下半年经济增长压力依旧较大。下半年，预计央行继续坚持稳健的货币政策，兼顾总量和结构性货币政策工具，大力支持科技创新、实体经济和中小微企业发展，一定程度上对债市形成利好。

市场层面，经历上半年债券牛市，债券收益率已处于历史较低分位水平，有一定调整压力。同时经济下行压力依旧较大，债券市场大幅调整风险不大。政策层面趋于稳定，货币政策以稳健为主，货币环境维持宽松。下半年，宽地产、宽财政、提振消费等政策或对债券市场形成扰动。

预计下半年，债券市场大幅调整风险不大，债市以横盘震荡为主，收益率中枢或缓慢下移。从投资性价比角度看，具有安全边际的短久期债券具有较好的配置价值，以票息为主的投资策略占优。同时长端高等级优质信用债及长端利率债具有一定的波段投资价值。

在此背景下，结合基金定位，下半年，我们将继续坚持中性偏积极的投资思路，灵活调整组合久期，优化杠杆使用，积极参与确定性较大的波段机会，增厚组合收益，在保障组合资产安全和流动性充裕的前提下，努力为投资人创造长期稳健的投资收益。

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 2023 年 6 月 30 日，期末可供分配利润为 9,115,756.09 元，其中长盛盛启债券 A 期末可供分配利润为 9,114,067.22 元（长盛盛启债券 A 的未分配利润已实现部分为 11,797,807.17 元，未分配利润未实现部分为-2,683,739.95 元）；长盛盛启债券 C 期末可供分配利润 1,688.87 元（长盛盛启债券 C 的未分配利润已实现部分为 2,251.75 元，未分配利润未实现部分为-562.88 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，本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，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份额持有人利益的行为。

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，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、基金费用开支以及利润分配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、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：长盛盛启债券型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日
资产：		
银行存款	6.4.7.1	784,098.09
结算备付金		54,734,576.34
存出保证金		34,551.43
交易性金融资产	6.4.7.2	1,996,824,074.38
其中：股票投资		-
基金投资		-
债券投资		1,996,824,074.38
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	-
债权投资	6.4.7.5	-
其中：债券投资		-
资产支持证券投资		-
其他投资		-
其他债权投资	6.4.7.6	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-
应收清算款		-
应收股利		-
应收申购款		10.00
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.8	-
资产总计		2,052,377,310.24
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日
负债：		
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		44,013,227.98
应付清算款		-
应付赎回款		250.75
应付管理人报酬		494,580.04
应付托管费		164,860.00
应付销售服务费		69.93
应付投资顾问费		-
应交税费		214,956.07

应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.9	39,071.00
负债合计		44,927,015.77
净资产：		
实收基金	6.4.7.10	1,998,334,538.38
其他综合收益	6.4.7.11	-
未分配利润	6.4.7.12	9,115,756.09
净资产合计		2,007,450,294.47
负债和净资产总计		2,052,377,310.24

注：1、报告截止日 2023 年 06 月 30 日，长盛盛启债券 A 的基金份额净值为 1.0046 元，份额总额为 1,997,915,728.56 份；长盛盛启债券 C 的基金份额净值为 1.0040 元，份额总额为 418,809.82 份。基金份额总额 1,998,334,538.38 份。

2、本基金基金合同生效日为 2023 年 4 月 11 日，无上年度可比期间。

6.2 利润表

会计主体：长盛盛启债券型证券投资基金

本报告期：2023 年 4 月 11 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 4 月 11 日（基金合同 生效日）至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		8,904,040.76
1. 利息收入		1,688,181.70
其中：存款利息收入	6.4.7.13	123,461.13
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		1,564,720.57
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		9,903,405.35
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.15	9,903,405.35
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-
股利收益	6.4.7.19	-
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）	6.4.7.20	-2,687,546.59
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	0.30
减：二、营业总支出		1,571,041.68
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,006,764.56
2. 托管费	6.4.10.2.2	335,588.16
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	605.25
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		177,773.72
其中：卖出回购金融资产支出		177,773.72
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-
7. 税金及附加		33,183.85
8. 其他费用	6.4.7.23	17,126.14
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		7,332,999.08
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		7,332,999.08
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		7,332,999.08

注：本基金合同于 2023 年 4 月 11 日生效，本报告期自 2023 年 4 月 11 日至 2023 年 6 月 30 日，无上年度可比期间。

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：长盛盛启债券型证券投资基金

本报告期：2023 年 4 月 11 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2023 年 4 月 11 日（基金合同生效日）至 2023 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）	-	-	-	-
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）	208,425,741.00	-	-	208,425,741.00
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	1,789,908,797.38	-	9,115,756.09	1,799,024,553.47

(一)、综合收益总额	-	-	7,332,999.08	7,332,999.08
(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)	1,789,908,797.38	-	1,782,757.01	1,791,691,554.39
其中：1. 基金申购款	3,957,622,336.85	-	4,747,673.65	3,962,370,010.50
2. 基金赎回款	-2,167,713,539.47	-	-2,964,916.64	-2,170,678,456.11
(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)	1,998,334,538.38	-	9,115,756.09	2,007,450,294.47

注：本基金合同于 2023 年 4 月 11 日生效，本报告期自 2023 年 4 月 11 日至 2023 年 6 月 30 日，无上年度可比期间。

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：

胡甲

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

长盛盛启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〔2022〕3163 号的注册，由长盛基金管理有限公司于自 2023 年 4 月 6 日至 2023 年 4 月 10 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（2023）验字第 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 2023 年 4 月 11 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。截至 2023 年 4 月 11 日止，长盛盛启债券 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 208,072,898.97 元，折合 208,072,898.97 份长盛盛启债券 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 10.29 元，折合 10.29 份长盛盛启债券 A 类基金份额；以上收到的实收基金共计人民币 208,072,909.26 元，折合 208,072,909.26 份长盛盛启债券 A 类基金份额。长盛盛启债券 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 352,830.71 元，折合 352,830.71 份长盛盛启债券 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 1.03 元，折合 1.03 份长盛盛启债券 C 类基金份额；以上收到的实收基金共计人民币 352,831.74 元，折合 352,831.74 份长盛盛启债券 C 类基金份额。长盛盛启债券 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 208,425,741.00 元，分别折合成 A 类及 C 类基金份额，合计折合 208,425,741.00 份长盛盛启债券基金份额。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，基金托管人为徽商银行股份有限公司。

本基金根据申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人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，称为 A 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 类和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类和 C 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、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、证券公司短期公司债券、政府支持机构债券及政府支持债、可分离交易可转债的纯债部分等债券及其他经中国证监会允许基金投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款、通知存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场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）、可交换债券和国债期货。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。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%；本基金持有的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《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（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 2023 年 06 月 30 日的财务状况以及 2023 年 04 月 11 日（基金合同生效日）至 2023 年 06 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本期财务报表的实际编制期间系自 2023 年 4 月 11 日（基金合同生效日）起至 2023 年 6 月 30 日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时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

除由于金融资产转移不符合终止确认条件或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债以

外，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。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，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。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的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按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映

公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面

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

(2) 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) 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；

(4) 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；

(5) 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。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，与所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

6.4.4.13 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

- (1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；
- (2) 能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
- (3) 能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

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

本基金本报告期无会计政策变更。

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 2023年6月30日
活期存款	784,098.09
等于：本金	783,966.04
加：应计利息	132.05
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	784,098.09

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023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	196,708,871.51	3,320,455.88	198,711,455.88	-1,317,871.51
	银行间市场	1,768,781,675.08	30,700,618.50	1,798,112,618.50	-1,369,675.08
	合计	1,965,490,546.59	34,021,074.38	1,996,824,074.38	-2,687,546.59
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	1,965,490,546.59	34,021,074.38	1,996,824,074.38	-2,687,546.59	

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

无。

6.4.7.5 债权投资

无。

6.4.7.6 其他债权投资

无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

无。

6.4.7.8 其他资产

无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	22,344.86
其中：交易所市场	-
银行间市场	22,344.86
应付利息	-
预提费用	16,726.14
合计	39,071.00

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

长盛盛启债券 A

项目	本期 2023年4月11日（基金合同生效日）至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	208,072,909.26	208,072,909.26
本期申购	3,945,475,595.78	3,945,475,595.78
本期赎回（以“-”号填列）	-2,155,632,776.48	-2,155,632,776.48
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	1,997,915,728.56	1,997,915,728.56

长盛盛启债券 C

项目	本期 2023 年 4 月 11 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	352,831.74	352,831.74
本期申购	12,146,741.07	12,146,741.07
本期赎回（以“-”号填列）	-12,080,762.99	-12,080,762.99
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	418,809.82	418,809.82

注：(1)本基金合同生效日为 2023 年 4 月 11 日。

(2)赎回含转换出。

(3)本基金设立时，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 208,072,898.97 元，折合 208,072,898.97 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 10.29 元，折合 10.29 份 A 类基金份额；以上收到的实收基金共计人民币 208,072,909.26 元，折合 208,072,909.26 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 352,830.71 元，折合 352,830.71 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 1.03 元，折合 1.03 份 C 类基金份额；以上收到的实收基金共计人民币 352,831.74 元，折合 352,831.74 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 208,425,741.00 元，分别折合成 A 类及 C 类基金份额，合计折合 208,425,741.00 份基金份额。

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

长盛盛启债券 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	10,016,285.39	-2,686,907.52	7,329,377.87
本期基金份额交易产生的变动数	1,781,521.78	3,167.57	1,784,689.35
其中：基金申购款	4,734,938.18	-58.94	4,734,879.24
基金赎回款	-2,953,416.40	3,226.51	-2,950,189.89
本期已分配利润	-	-	-
本期末	11,797,807.17	-2,683,739.95	9,114,067.22

长盛盛启债券 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	4,260.28	-639.07	3,621.21
本期基金份额交易产生的变动数	-2,008.53	76.19	-1,932.34
其中：基金申购款	12,899.35	-104.94	12,794.41
基金赎回款	-14,907.88	181.13	-14,726.75
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,251.75	-562.88	1,688.87

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年4月11日（基金合同生效日）至2023年6月30日
活期存款利息收入	64,490.87
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	58,926.78
其他	43.48
合计	123,461.13

6.4.7.14 股票投资收益

无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2023年4月11日（基金合同生效日）至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	9,911,758.26
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-8,352.91
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	9,903,405.35

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年4月11日（基金合同生效日）至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	431,575,806.39

减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	427,522,125.90
减：应计利息总额	4,049,135.90
减：交易费用	12,897.50
买卖债券差价收入	-8,352.91

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

无。

6.4.7.18 衍生工具收益

无。

6.4.7.19 股利收益

无。

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023年4月11日（基金合同生效日）至2023年6月30日
1. 交易性金融资产	-2,687,546.59
股票投资	-
债券投资	-2,687,546.59
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	-2,687,546.59

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年4月11日（基金合同生效日）至2023年6月30日
基金赎回费收入	0.30
合计	0.30

6.4.7.22 信用减值损失

无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 4 月 11 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	12,226.14
信息披露费	-
证券出借违约金	-
账户维护费	4,500.00
开户费	400.00
合计	17,126.14

6.4.7.24 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（“长盛基金公司”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
徽商银行股份有限公司（“徽商银行”）	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
	2023 年 4 月 11 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,006,764.56
其中：支付销售机构的客户维护费	23,576.42

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.30% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 4 月 11 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	335,588.16

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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		
	2023 年 4 月 11 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长盛盛启债券 A	长盛盛启债券 C	合计
长盛基金公司	-	0.11	0.11
合计	-	0.11	0.11

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 0.20% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

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

单位：人民币元

本期 2023 年 4 月 11 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日						
银行间市场交易的 各关联方名称	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
徽商银行	-	-	-	-	44,010,00 0.00	10,055 .98

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

份额单位：份

长盛盛启债券 A

关联方名称	本期末 2023 年 6 月 30 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例 (%)
徽商银行	1,997,660,805.83	99.9872

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的相关费用符合基金招募说明书、交易所、登记结算机构的有关规定，对于分级基金，比例的分母采用各自级别的份额。

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 2023 年 4 月 11 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
徽商银行	784,098.09	64,490.87

合计	784,098.09	64,490.87
----	------------	-----------

注：本基金的银行存款由基金托管人徽商银行保管，按银行同业/协议利率计息。

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（2023 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 2023 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 44,013,227.98 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
210303	21 进出 03	2023 年 7 月 3 日	101.53	489,000	49,649,212.13
合计				489,000	49,649,212.13

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

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发行的证券，不得超过该证券的 10%。

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

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 2023 年 6 月 30 日
AAA	1,352,984,672.79
AAA 以下	156,413,781.69
未评级	487,425,619.90
合计	1,996,824,074.38

注：未评级部分为政策性金融债、中期票据和公司债。

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 2023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	783,966.04	-	-	132.05	784,098.09
结算备付金	54,712,417.80	-	-	22,158.54	54,734,576.34
存出保证金	34,537.48	-	-	13.95	34,551.43
交易性金融资产	449,317,500.00	868,331,000.00	645,154,500.00	34,021,074.38	1,996,824,074.38
应收申购款	-	-	-	10.00	10.00
资产总计	504,848,421.32	868,331,000.00	645,154,500.00	34,043,388.92	2,052,377,310.24
负债					
应付赎回款	-	-	-	250.75	250.75
应付管理人报酬	-	-	-	494,580.04	494,580.04
应付托管费	-	-	-	164,860.00	164,860.00
卖出回购金融资产款	44,009,813.98	-	-	3,414.00	44,013,227.98
应付销售服务费	-	-	-	69.93	69.93
应交税费	-	-	-	214,956.07	214,956.07
其他负债	-	-	-	39,071.00	39,071.00
负债总计	44,009,813.98	-	-	917,201.79	44,927,015.77
利率敏感度缺口	460,838,607.34	868,331,000.00	645,154,500.00	33,126,187.13	2,007,450,294.47

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

截至本期末，本基金成立未满一年，尚无充足的经验数据。

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 2023年6月30日
第一层次	-
第二层次	1,996,824,074.38
第三层次	-
合计	1,996,824,074.38

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。本基金本报告期持有的持续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

本基金本报告期末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	1,996,824,074.38	97.29
	其中：债券	1,996,824,074.38	97.29

	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	55,518,674.43	2.71
8	其他各项资产	34,561.43	0.00
9	合计	2,052,377,310.24	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末基金资产净值 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末基金资产净值 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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	101,532,131.15	5.06
	其中：政策性金融债	101,532,131.15	5.06
4	企业债券	983,129,014.29	48.97
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	912,162,928.94	45.44
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-

10	合计	1,996,824,074.38	99.47
----	----	------------------	-------

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	101800928	18 淮南矿 MTN003	1,900,000	199,353,153.42	9.93
2	138824	23 江东 01	1,600,000	168,104,898.62	8.37
3	210303	21 进出 03	1,000,000	101,532,131.15	5.06
4	102281231	22 华远集团 MTN001	950,000	95,415,601.64	4.75
5	2180515	21 利民债	900,000	93,749,044.93	4.67

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

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

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	34,551.43
2	应收清算款	-

3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	10.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	34,561.43

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 (%)
长盛盛启债券 A	134	14,909,818.87	1,997,660,805.83	99.99	254,922.73	0.01
长盛盛启债券 C	174	2,406.95	0.00	0.00	418,809.82	100.00
合计	308	6,488,099.15	1,997,660,805.83	99.97	673,732.55	0.03

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	长盛盛启债券 A	57,579.64	0.0029
	长盛盛启债券 C	2,619.90	0.0256
	合计	60,199.54	0.0030

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	长盛盛启债券 A	0~10
	长盛盛启债券 C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	长盛盛启债券 A	0
	长盛盛启债券 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	长盛盛启债券 A	长盛盛启债券 C
基金合同生效日（2023 年 4 月 11 日）基金份额总额	208,072,909.26	352,831.74
基金合同生效日起至报告期末基金总申购份额	3,945,475,595.78	12,146,741.07
减：基金合同生效日起至报告期末基金总赎回份额	2,155,632,776.48	12,080,762.99
基金合同生效日起至报告期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	1,997,915,728.56	418,809.82

§ 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

根据公司第八届董事会相关会议决议，选举胡甲先生担任公司董事长，同时代行公司总经理职务，代行总经理职务期限不超 6 个月；高民和先生不再担任公司董事长，周兵先生不再担任公司总经理职务。公司已按规定向相关监管机构报备并进行公告。

10.2.2 基金经理变动情况

本报告期内本基金基金经理未发生变动。

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，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

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

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	管理人
受到稽查或处罚等措施的时间	2023 年 5 月 11 日
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证监会北京监管局
受到的具体措施类型	责令改正
受到稽查或处罚等措施的原因	内控管理不完善
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	公司已完成整改，整改措施主要包括完善内部制度、优化管控流程等
其他	-

10.6.2 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 (%)	
招商证券	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	债券交易	债券回购交易	权证交易
-----	------	--------	------

称	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
招商证券	196,094,700.00	100.00	11,461,318,000.00	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：无。

(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	长盛盛启债券型证券投资基金招募说明书	中国证监会指定披露媒介	2023 年 3 月 30 日
2	长盛盛启债券型证券投资基金基金合同及招募说明书提示性公告	中国证监会指定披露媒介	2023 年 3 月 30 日
3	长盛盛启债券型证券投资基金基金份额发售公告	中国证监会指定披露媒介	2023 年 3 月 30 日
4	长盛盛启债券型证券投资基金基金产品资料概要	中国证监会指定披露媒介	2023 年 3 月 30 日
5	长盛盛启债券型证券投资基金基金合同	中国证监会指定披露媒介	2023 年 3 月 30 日
6	长盛盛启债券型证券投资基金托管协议	中国证监会指定披露媒介	2023 年 3 月 30 日
7	关于长盛盛启债券型证券投资基金在部分销售机构提前结束募集期的公告	中国证监会指定披露媒介	2023 年 4 月 7 日
8	长盛盛启债券型证券投资基金基金合同生效公告	中国证监会指定披露媒介	2023 年 4 月 12 日
9	长盛盛启债券型证券投资基金开放日常申购 赎回 转换及定期定额投资业务的公告	中国证监会指定披露媒介	2023 年 4 月 15 日
10	长盛基金管理有限公司关于旗下基金增加平安银行为代销机构的公告	中国证监会指定披露媒介	2023 年 4 月 26 日
11	长盛基金管理有限公司关于增加中信建投证券为旗下部分开放式基金代销机构及开通基金定投业务与转换业务的公告	中国证监会指定披露媒介	2023 年 5 月 4 日
12	长盛基金管理有限公司关于增加国元证券为旗下部分开放式基金代销机构及开通基金定投业务与转换业务的公告	中国证监会指定披露媒介	2023 年 6 月 7 日
13	长盛盛启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	2023 年 6 月 13 日
14	长盛基金管理有限公司关于部分基金增加销售机构的公告	中国证监会指定披露媒介	2023 年 6 月 28 日
15	长盛基金管理有限公司关于增加腾安基金为旗下部分基金销售机构开通定投、费率优惠业务的公告	中国证监会指定披露媒介	2023 年 6 月 28 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	报告期内持有基金份额变化情况	报告期末持有基金情况
---	----------------	------------

投资者类别	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	20230418~20230508	0.00	19,999,000.00	19,999,000.00	0.00	0.00
	2	20230411~20230417	0.00	44,999,000.00	44,999,000.00	0.00	0.00
	3	20230509~20230516	0.00	998,800,439.47	998,800,439.47	0.00	0.00
	4	20230411~20230630	0.00	1,997,660,805.83	0.00	1,997,660,805.83	99.97
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、长盛盛启债券型证券投资基金相关批准文件；
- 2、《长盛盛启债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长盛盛启债券型证券投资基金托管协议》；
- 4、《长盛盛启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

2023 年 8 月 30 日