

长盛盛华一年定期开放债券型发起式证券投资基金
2024年第3季度报告

2024年9月30日

基金管理人：长盛基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

报告送出日期：2024年10月25日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 10 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 07 月 01 日起至 09 月 30 日止。

§2 基金产品概况

| | |
|------------|---|
| 基金简称 | 长盛盛华一年定开债券发起式 |
| 基金主代码 | 018247 |
| 基金运作方式 | 契约型定期开放式 |
| 基金合同生效日 | 2023 年 12 月 4 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 510,000,350.14 份 |
| 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>本基金在封闭期与开放期采取不同的投资策略。</p> <p>(一) 封闭期投资策略</p> <p>1、大类资产配置策略：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>2、债券组合管理策略：(1) 利率策略 (2) 类属配置策略 (3) 信用策略 (4) 相对价值策略 (5) 债券选择策略 (6) 可转换债券及可交换债券投资策略。</p> <p>3、国债期货投资策略：本基金在进行国债期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对债券交易市场和期货市场运行趋势的研究，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。</p> <p>4、信用衍生品投资策略：本基金按照风险管理原则，以风险对冲为目的，参与信用衍生品交易。本基金将根据所持标的债券等固定收益</p> |

| | |
|--------|--|
| | 品种的投资策略，审慎开展信用衍生品投资，合理确定信用衍生品的投资金额、期限以及信用风险敞口等。 (二) 开放期投资策略 开放期内，本基金为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种，防范流动性风险，满足开放期流动性的需求。 |
| 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。 |
| 基金管理人 | 长盛基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 兴业银行股份有限公司 |

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（2024年7月1日-2024年9月30日） |
|-----------------|---------------------------|
| 1. 本期已实现收益 | 2,861,294.03 |
| 2. 本期利润 | 1,667,682.12 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0033 |
| 4. 期末基金资产净值 | 520,752,380.41 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.0211 |

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、所列数据截止到 2024 年 09 月 30 日。

3、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。

4、本基金基金合同生效日为 2023 年 12 月 4 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

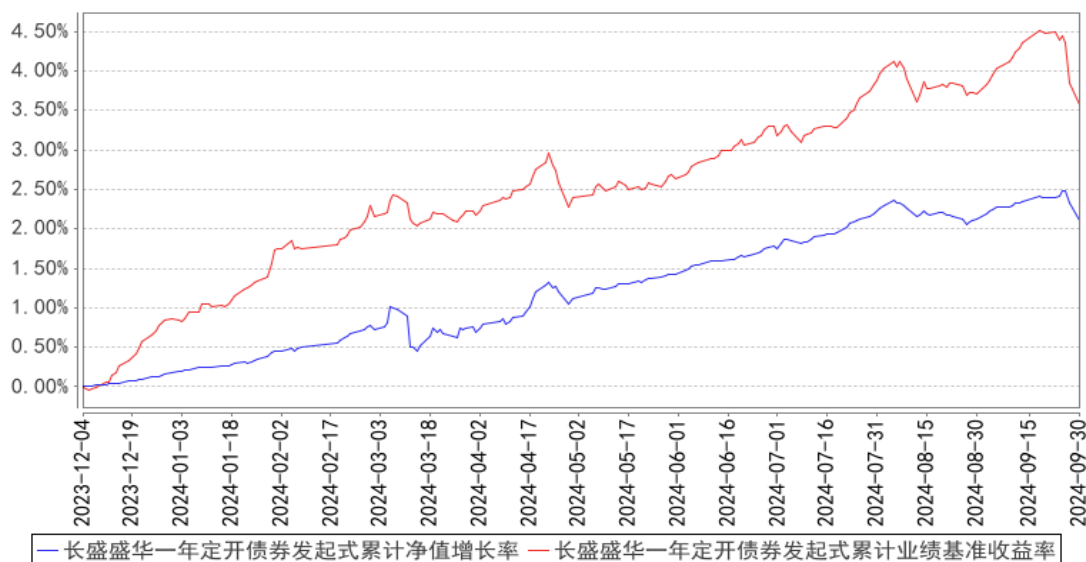
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 净值增长率 ① | 净值增长率 标准差② | 业绩比较基 准收益率③ | 业绩比较基 准收益率标 准差④ | ①—③ | ②—④ |
|-------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|--------|
| 过去三个月 | 0.32% | 0.05% | 0.26% | 0.10% | 0.06% | -0.05% |
| 过去六个月 | 1.34% | 0.04% | 1.32% | 0.09% | 0.02% | -0.05% |
| 自基金合同 | 2.11% | 0.05% | 3.57% | 0.08% | -1.46% | -0.03% |

| | | | | | | |
|-------|--|--|--|--|--|--|
| 生效起至今 | | | | | | |
|-------|--|--|--|--|--|--|

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

长盛盛华一年定开债券发起式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 12 月 4 日，截至本报告期末本基金自合同生效未满一年。
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。本基金已完成建仓但报告期末距建仓结束不满一年。截至建仓期结束日，本基金的各项资产配置比例符合本基金合同的有关约定。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 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|-----|---|-----------------|------|--------|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 王赛飞 | 本基金基金经理，长盛添利宝货币市场基金基金经理，长盛盛琪一年期定期开放债券型证券投资基金基金经理。 | 2023 年 12 月 4 日 | - | 12 年 | 王赛飞女士，硕士。曾任大公国际资信评估有限公司分析师、信用评审委员会委员。2015 年 7 月加入长盛基金管理有限公司固定收益部，曾任信用研究员、基金经理助理等职务。 |

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。

4.1.1 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 公平交易专项说明

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

1、报告期内行情回顾

报告期内，债券市场出现较大幅度的震荡。7 月央行调降 OMO 利率后，以十年国债为代表的债券收益率一度下行至 2.12% 附近。但此后受大行卖出中长期国债及债券交易严监管等因素影响，十年国债收益率于 8 月上中旬回调至季初的 2.25% 附近。市场对于强财政政策刺激的预期不高，后续十年国债收益率逐渐回落。9 月底，央行在发布会中宣布了降准降息、降低存量房贷利率、创立创新工具支持权益市场等政策，随着权益市场的大幅反弹，债券收益率出现显著回调。信用债方面，各期限信用债收益率整体均在季末出现较大幅度上行，信用利差走阔。

2、报告期内本基金投资策略分析

报告期内本基金继续根据合同要求，结合对市场情况的分析判断对组合进行调整。一方面，基金继续在严控信用风险的前提下积极参与信用债一二级市场的投资机会，努力提升票息收益；另一方面，基金根据市场情况对久期进行一定的灵活操作，力争为持有人获取稳健的投资收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末基金份额净值为 1.0211 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.32%，同期业绩比较基准收益率为 0.26%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金为发起式基金，截止本报告期末，本基金成立未满三年，不适用本项说明。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 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 | 515,345,949.78 | 98.90 |
| | 其中：债券 | 515,345,949.78 | 98.90 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | 1,343,330.00 | 0.26 |

| | | | |
|---|-------------------|----------------|--------|
| 6 | 买入返售金融资产 | 3,800,315.45 | 0.73 |
| | 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 | 594,540.57 | 0.11 |
| 8 | 其他资产 | 6,214.08 | 0.00 |
| 9 | 合计 | 521,090,349.88 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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。

5.2.2 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。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|----------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 349,159,527.45 | 67.05 |
| | 其中：政策性金融债 | 134,779,928.53 | 25.88 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | 46,072,959.46 | 8.85 |
| 6 | 中期票据 | 70,888,495.75 | 13.61 |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | 49,224,967.12 | 9.45 |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 515,345,949.78 | 98.96 |

5.5 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债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|---------------|---------|---------------|--------------|
| 1 | 200203 | 20 国开 03 | 500,000 | 51,394,330.60 | 9.87 |
| 2 | 112483309 | 24 南京银行 CD186 | 500,000 | 49,224,967.12 | 9.45 |
| 3 | 230208 | 23 国开 08 | 400,000 | 41,256,252.05 | 7.92 |
| 4 | 2228046 | 22 中信银行 02 | 400,000 | 40,316,931.51 | 7.74 |
| 5 | 230203 | 23 国开 03 | 300,000 | 31,394,754.10 | 6.03 |

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资 明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货投资。

5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 本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

(1) 22 中信银行 02

2023 年 12 月 1 日，金罚决字（2023）15 号显示，中信银行股份有限公司存在违反高管准入管理相关规定等 56 项违法违规事实，没收违法所得并处罚款合计 22,475.18 万元。2024 年 1 月 5 日，金罚决字（2023）69 号显示，中信银行股份有限公司存在部分重要信息系统应认定未认定，相关系统未建灾备或灾难恢复能力不符合监管要求等 6 项违法违规事实，被处罚款 400 万元。本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合法律法规、基金合同和公司投资制度的规定。

(2) 24 海通 04

2023 年 11 月 9 日，证监会发布公告显示，因在沃得农机 IPO 项目的保荐过程中未勤勉尽责，证监会对海通证券以及 2 名保代采取出具警示函的监管措施。2024 年 1 月 5 日，深交所决定对海通证券采取书面警示的自律监管措施，原因是海通证券在担任江苏沃得农业机械股份有限公司首

次公开发行股票并在创业板上市项目保荐人过程中，存在多项违规行为。2024 年 1 月 29 日，海通证券因首发保荐业务履职尽责明显不到位、投行质控内核部门未识别项目重大风险及对尽职调查把关不审慎等缺陷，上交所决定采取以下监管措施：对海通证券予以监管谈话，对公司相关责任人予以监管警示。2024 年 4 月 19 日，海通证券因涉及中核钛白实际控制人王泽龙涉嫌违反限制性规定转让股票事件，被中国证监会责令改正，给予警告，没收违法所得 78.94 万元，罚款 697.5 万元，合计 776.44 万元。本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合法律法规、基金合同和公司投资制度的规定。

(3) 24 申证 02

2024 年 2 月 8 日，证监会官网行政处罚显示，申万宏源存在两项违规行为，一是承销尽调不规范，部分项目未对可能影响发行人偿债能力的事项进行充分关注和核查；二是受托管理履职尽责不到位，个别项目未对存续期影响发行人偿债能力事项进行跟踪并及时分析影响，证监会决定对申万宏源采取责令改正的行政监管措施。本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合法律法规、基金合同和公司投资制度的规定。

除上述事项外，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。

5.10.2 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。

5.10.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|----------|
| 1 | 存出保证金 | 6,214.08 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 6,214.08 |

5.10.4 报告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。

5.10.5 报告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。

5.10.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---------------------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 510,000,350.14 |
| 报告期期间基金总申购份额 | - |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | - |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 510,000,350.14 |

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

| | |
|--------------------------|---------------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额 | 10,001,350.14 |
| 报告期期间买入/申购总份额 | - |
| 报告期期间卖出/赎回总份额 | - |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额 | 10,001,350.14 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%） | 1.96 |

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

| 项目 | 持有份额总数 | 持有份额占基金总份额比例(%) | 发起份额总数 | 发起份额占基金总份额比例(%) | 发起份额承诺持有期限 |
|-----------------|---------------|-----------------|---------------|-----------------|-----------------|
| 基金管理人 固有资金 | 10,001,350.14 | 1.96 | 10,001,350.14 | 1.96 | 自基金合同生效之日起不少于三年 |
| 基金管理人 高级管理人员 | - | - | - | - | - |
| 基金经理等 | - | - | - | - | - |

| | | | | | |
|-------|---------------|------|---------------|------|---|
| 人员 | | | | | |
| 基金管理人 | - | - | - | - | - |
| 股东 | | | | | |
| 其他 | - | - | - | - | - |
| 合计 | 10,001,350.14 | 1.96 | 10,001,350.14 | 1.96 | - |

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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 | 20240701~20240930 | 499,999,000.00 | 0.00 | 0.00 | 499,999,000.00 | 98.04 |
| 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。 | | | | | | | |

9.2 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。

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- 1、长盛盛华一年定期开放债券型发起式证券投资基金相关批准文件；
- 2、《长盛盛华一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《长盛盛华一年定期开放债券型发起式证券投资基金托管协议》；
- 4、《长盛盛华一年定期开放债券型发起式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。

10.2 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。

10.3 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

2024 年 10 月 25 日