

长盛积极配置债券型证券投资基金

2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：长盛基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2024 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 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 2024 年 01 月 01 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	6
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
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	11
§ 5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
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	11
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	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产变动表	14
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	33
7.1 期末基金资产组合情况	33
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	33
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	34
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	40
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	42
§ 8 基金份额持有人信息	46
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	46
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
§ 9 开放式基金份额变动	46
§ 10 重大事件揭示	47
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	47
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	47
10.8 其他重大事件	48
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	49
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	49
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	49
§ 12 备查文件目录	49
12.1 备查文件目录	49
12.2 存放地点	50
12.3 查阅方式	50

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长盛积极配置债券型证券投资基金
基金简称	长盛积极配置债券
基金主代码	080003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008 年 10 月 8 日
基金管理人	长盛基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	182,153,447.77 份
基金合同存续期	不定期

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,通过积极主动的投资管理,追求基金资产的长期稳定增值,并力争获得超过业绩比较基准的投资业绩。
投资策略	本基金为积极投资策略的债券型基金,不同于传统债券型基金的投资策略特点,本基金在债券类资产配置上更强调积极主动管理。在债券类资产配置上,本基金通过积极投资配置相对收益率较高的企业债、公司债、可转换债、可分离交易可转债、资产支持证券等创新债券品种,并灵活运用组合久期调整、收益率曲线调整、信用利差和相对价值等策略积极把握固定收益证券市场中投资机会,以获取各类债券的超额投资收益。在股票类资产投资上,通过积极投资于一级市场和二级市场高成长性和具有高投资价值的股票,来获取股票市场的积极收益。此外,本基金还积极通过债券回购等手段提高基金资产的流动性和杠杆性用于短期投资于高收益的金融工具。
业绩比较基准	中证全债指数收益率×90%+沪深 300 指数收益率×10%
风险收益特征	本基金为债券型基金,其长期平均风险和预期收益率低于混合型基金,高于货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	长盛基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
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	021-60637228
传真	010-86497999	021-60635778
注册地址	深圳市福田区中心区福中三路诺德金融中心主楼 10D	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址	北京市朝阳区安定路 5 号院 3 号楼中建财富国际中心 3-5 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	100029	100033

法定代表人	胡甲	张金良
-------	----	-----

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金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(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	1,043,118.00
本期利润	3,193,848.15
加权平均基金份额本期利润	0.0175
本期加权平均净值利润率	1.52%
本期基金份额净值增长率	1.54%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	20,736,861.59
期末可供分配基金份额利润	0.1138
期末基金资产净值	210,738,251.91
期末基金份额净值	1.1569
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	86.29%

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。

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	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	-1.19%	0.24%	0.56%	0.05%	-1.75%	0.19%
过去三个月	0.51%	0.22%	1.53%	0.08%	-1.02%	0.14%
过去六个月	1.54%	0.21%	4.01%	0.10%	-2.47%	0.11%
过去一年	-0.98%	0.24%	4.90%	0.09%	-5.88%	0.15%
过去三年	-6.61%	0.32%	11.19%	0.11%	-17.80%	0.21%
自基金合同生效起至今	86.29%	0.34%	108.06%	0.17%	-21.77%	0.17%

注：本基金业绩比较基准：中证全债指数收益率×90%+沪深 300 指数收益率×10%

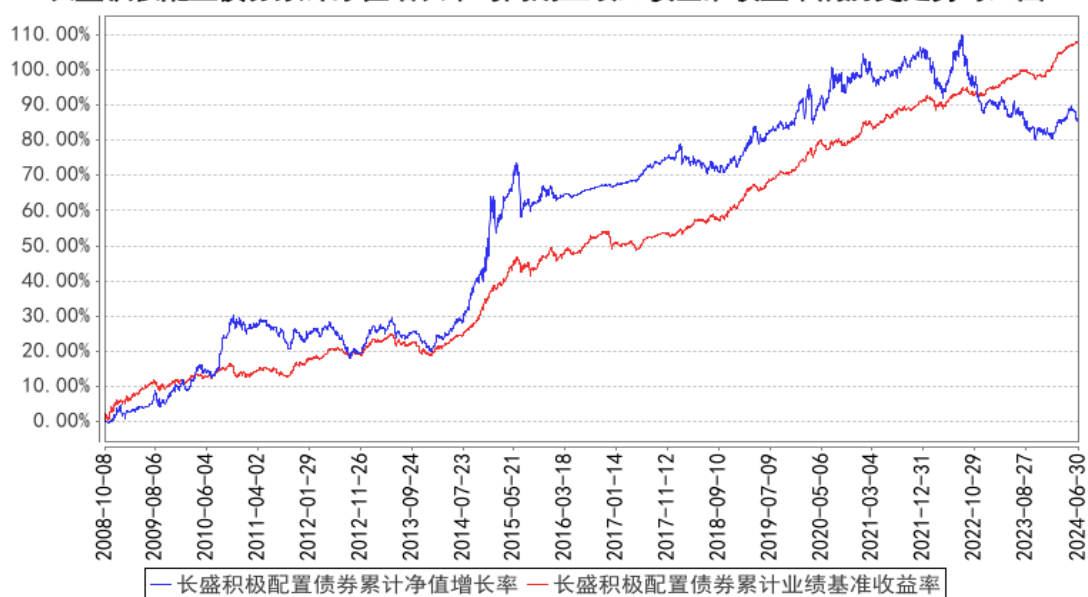
中证全债指数是中证指数公司编制的综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数。该指数的样本由银行间市场和沪深交易所市场的国债、金融债券及企业债券组成，为债券投资者提供投资分析工具和业绩评价基准。

沪深 300 指数是由上海和深圳证券交易所中选取 300 只 A 股作为样本编制而成的成份股指数，具有良好的市场代表性。沪深 300 指数是沪深证券交易所第一次联合发布的反映 A 股市场整体走势的指数。

由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照 90%、10% 的比例采取再平衡，再用连锁计算的方式得到基准指数的时间序列。

3.2.2 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

长盛积极配置债券累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：按照本基金合同规定，本基金基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资

组合比例符合基金合同的约定。截止报告日，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。长盛基金注册地为深圳，总部办公地位于北京，在北京、上海、成都等地设有分支机构，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（DBS Bank Ltd.）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 2024 年 6 月 30 日，基金管理人共管理七十二只开放式基金，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		
杨哲	本基金基金经理,长盛可转债债券型证券投资基金基金经理,长盛安盈混合型证券投资基金基金经理,长盛稳怡添利债券型证券投资基金基金经理。	2021年11月2日	-	14年	杨哲先生,硕士。曾任大公国际资信评估有限公司公司信用分析师、信用评审委员会委员。2013年9月加入长盛基金管理有限公司。

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

报告期内，宏观经济整体平稳运行，外需保持较强韧性，制造业投资较快增长，但房地产投

资下滑、居民消费偏弱、基建投资增速较慢。5 月和 6 月 PMI 指数再度降至收缩区间，显示当前经济改善基础尚不稳固。4 月政治局会议提出加快财政支出、研究地产去库存等政策，其后相关政策陆续出台。

报告期内，债市延续牛市行情。在地产销售大幅下滑、债券配置需求旺盛、相对宽松的流动性局面下，各品种债券收益率均呈现较大下行，信用利差、期限利差均压缩至较低水平。

权益市场方面，A 股经历了先跌后涨再次下跌的震荡行情。从申万一级行业看，行业结构分化明显，其中银行、煤炭、公用事业、家电、石油石化等行业涨幅居前，而计算机、商贸、社服、传媒等行业跌幅较大。

可转债市场整体跟随股市走出震荡行情。可转债价格中位数处于近两年较低位置，整体性价比有所提升。6 月以来，受股市震荡调整影响，叠加评级下调、监管问询函等因素，转债市场有所调整，尤其是弱资质可转债普遍出现较大跌幅。

2、报告期内本基金投资策略分析

债券投资方面，在经济复苏基础不牢固、资金配置需求旺盛、流动性相对宽松局面下，一方面重视债券票息价值，适度运用杠杆策略增强收益，另一方面，灵活运用久期策略，把握收益率下行的资本利得收益。权益资产方面，在经济动能切换、出口需求改善、财政政策适度发力局面下，股市表现为结构性的震荡行情，投资操作上，行业配置适度分散化，个股选择更重视盈利确定性和估值安全边际。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.1569 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.54%，同期业绩比较基准收益率为 4.01%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，经济仍处于新旧动能转换期，预期全年有望实现 5%左右的目标。政策方面，财政政策预期将保持必要支出强度，通过超长期国债等方式支持设备更新及消费品以旧换新等，货币政策运用利率和存款准备金率等政策工具，加大对实体经济支持力度，降低社会综合融资成本。

债券方面，国内总需求偏弱、债券配置需求旺盛、流动性宽松等背景下，债券仍具相对价值，债市行情仍有支撑；关注政府债供给增加、汇率及资金空转对货币政策的制约、重要会议政策导向等因素对行情的扰动。

可转债方面，投资操作需更重视个券挖掘和安全边际，以低价和高性价比转债为主，规避溢价过高品种、临近赎回品种及信用资质较弱个券。

股票方面，在经济复苏动能放缓和新旧动能切换局面下，综合考虑产业周期、基本面、估值

与资金结构等因素，适度把握市场结构性机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照《企业会计准则》、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引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。

本基金管理人设有估值工作小组，负责制定、评估、复核和修订基金估值程序和技术，适时更新估值相关制度，指导并监督各类投资品种的估值程序，评估会计政策变更的影响，对证券投资基金估值方法进行最终决策等。估值工作小组由总经理担任组长，督察长担任副组长，小组成员均具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备投资、研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可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，由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据和流通受限股票的折扣率数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的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

本报告期内，本基金未实施利润分配，符合法律法规和基金合同的相关约定。

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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基

金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

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

本托管人复核审查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。

§ 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：长盛积极配置债券型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	366,320.09	421,788.05
结算备付金		1,845,698.26	2,251,635.53
存出保证金		13,490.46	20,284.00
交易性金融资产	6.4.7.2	286,049,892.15	282,136,342.70
其中：股票投资		40,945,675.29	33,123,757.05
基金投资		-	-
债券投资		245,104,216.86	249,012,585.65
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	-	500,460.26
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		203,399.50	165,584.14
应收股利		-	-
应收申购款		701.54	1,546.46
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		288,479,502.00	285,497,641.14

负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 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		75,918,569.11	75,637,128.10
应付清算款		304,005.50	159,044.21
应付赎回款		175.58	397.66
应付管理人报酬		130,415.27	131,698.91
应付托管费		34,777.41	35,119.71
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		1,215,330.61	1,216,763.25
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	137,976.61	276,726.56
负债合计		77,741,250.09	77,456,878.40
净资产:			
实收基金	6.4.7.10	182,153,447.77	182,586,890.85
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	28,584,804.14	25,453,871.89
净资产合计		210,738,251.91	208,040,762.74
负债和净资产总计		288,479,502.00	285,497,641.14

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.1569 元，基金份额总额 182,153,447.77 份。

6.2 利润表

会计主体：长盛积极配置债券型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		5,140,843.76	428,453.09
1. 利息收入		15,711.08	26,065.58
其中：存款利息收入	6.4.7.13	15,050.83	25,447.36
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		660.25	618.22

其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		2,974,164.55	-2,263,300.22
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-2,239,276.15	-5,754,390.54
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	4,744,307.42	3,248,270.36
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	469,133.28	242,819.96
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	2,150,730.15	2,665,430.90
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	237.98	256.83
减：二、营业总支出		1,946,995.61	1,683,253.47
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	782,160.91	804,347.60
2. 托管费	6.4.10.2.2	208,576.27	214,492.69
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		837,476.93	549,027.23
其中：卖出回购金融资产 支出		837,476.93	549,027.23
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		9,153.90	6,550.80
8. 其他费用	6.4.7.23	109,627.60	108,835.15
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,193,848.15	-1,254,800.38
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,193,848.15	-1,254,800.38
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		3,193,848.15	-1,254,800.38

6.3 净资产变动表

会计主体：长盛积极配置债券型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	182,586,890.85	25,453,871.89	208,040,762.74
二、本期期初净资产	182,586,890.85	25,453,871.89	208,040,762.74
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-433,443.08	3,130,932.25	2,697,489.17
(一)、综合收益总额	-	3,193,848.15	3,193,848.15
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数 (净资产减少以“-”号填列)	-433,443.08	-62,915.90	-496,358.98
其中: 1. 基金申购款	93,215.52	13,915.67	107,131.19
2. 基金赎回款	-526,658.60	-76,831.57	-603,490.17
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动 (净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产	182,153,447.77	28,584,804.14	210,738,251.91
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	183,967,926.18	32,216,326.82	216,184,253.00
二、本期期初净资产	183,967,926.18	32,216,326.82	216,184,253.00
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-663,120.32	-1,371,765.77	-2,034,886.09
(一)、综合收益总额	-	-1,254,800.38	-1,254,800.38
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数 (净资产减少以“-”号填列)	-663,120.32	-116,965.39	-780,085.71
其中: 1. 基金申购款	108,699.53	19,367.92	128,067.45
2. 基金赎回款	-771,819.85	-136,333.31	-908,153.16

（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	183,304,805.86	30,844,561.05	214,149,366.91

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：

<u>胡甲</u>	<u>刁俊东</u>	<u>龚珉</u>
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

长盛积极配置债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)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[2008]第 984 号《关于核准长盛积极配置债券型证券投资基金募集的批复》核准,由长盛基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛积极配置债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,361,279,052.21 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2008)第 144 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《长盛积极配置债券型证券投资基金基金合同》于 2008 年 10 月 8 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,362,144,547.24 份基金份额,其中认购资金利息折合 865,495.03 份基金份额。本基金的基金管理人为长盛基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛积极配置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国内依法公开发行、上市的股票、债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具,其中投资于债券等固定收益类资产(含可转换债券)的比例不低于基金资产的 80%;投资于股票、权证等权益类证券的比例不超过基金资产的 20%,其中,权证投资的比例不超过基金资产的 3%;现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:中证全债指数收益率×90%+沪深 300 指数收益率×10%。

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、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(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》、《长盛积极配置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 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 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于 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 年 1 月 1 日至 2024 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。

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

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[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、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。

对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，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 2018 年 1 月 1 日起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，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、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。

(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。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(5) 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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	366,320.09
等于：本金	366,276.22
加：应计利息	43.87
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	366,320.09

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	40,201,733.48	-	40,945,675.29	743,941.81	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	77,586,144.91	540,844.90	76,974,517.24	-1,152,472.57
	银行间市场	161,872,570.29	2,793,699.62	168,129,699.62	3,463,429.71
	合计	239,458,715.20	3,334,544.52	245,104,216.86	2,310,957.14
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	279,660,448.68	3,334,544.52	286,049,892.15	3,054,898.95	

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。

6.4.7.4.1 期末买断式逆回购交易中取得的债券

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 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	0.19
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	16,922.05
其中：交易所市场	11,722.05
银行间市场	5,200.00
应付利息	-
预提费用	98,507.60
其他	22,546.77
合计	137,976.61

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	182,586,890.85	182,586,890.85
本期申购	93,215.52	93,215.52
本期赎回（以“-”号填列）	-526,658.60	-526,658.60
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	182,153,447.77	182,153,447.77

注：若本基金有分红及转换业务，申购含红利再投、转换入；赎回含转换出。

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

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	19,739,484.41	5,714,387.48	25,453,871.89
本期期初	19,739,484.41	5,714,387.48	25,453,871.89
本期利润	1,043,118.00	2,150,730.15	3,193,848.15
本期基金份额交易产生的变动数	-45,740.82	-17,175.08	-62,915.90
其中：基金申购款	9,793.08	4,122.59	13,915.67

基金赎回款	-55,533.90	-21,297.67	-76,831.57
本期已分配利润	-	-	-
本期末	20,736,861.59	7,847,942.55	28,584,804.14

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
活期存款利息收入		1,512.15
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		13,401.35
其他		137.33
合计		15,050.83

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
股票投资收益——买卖股票差价收入		-2,239,276.15
合计		-2,239,276.15

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
卖出股票成交总额		29,191,798.18
减：卖出股票成本总额		31,348,542.55
减：交易费用		82,531.78
买卖股票差价收入		-2,239,276.15

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	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
债券投资收益——利息收入		3,489,386.91
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入		1,254,920.51
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		4,744,307.42

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 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	155,450,202.47
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	152,457,857.27
减：应计利息总额	1,730,167.07
减：交易费用	7,257.62
买卖债券差价收入	1,254,920.51

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

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	469,133.28
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	469,133.28

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
1. 交易性金融资产	2,150,730.15
股票投资	748,430.13
债券投资	1,402,300.02
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	2,150,730.15

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	234.94
基金转换费收入	3.04
合计	237.98

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. 本基金的转换费由基金赎回费用及基金申购补差费用构成，其中不低于赎回费用的 25% 的部分归入基金财产。

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 2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	29,835.26
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行费用	1,520.00
账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	109,627.60

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
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	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 2024年1月1日至2024年6月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	782,160.91	804,347.60
其中：应支付销售机构的客户维护费	28,993.94	32,421.50
应支付基金管理人的净管理费	753,166.97	771,926.10

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 0.75% 的年管理费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年管理费率} / \text{当年天数}$$

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 2024年1月1日至2024年6月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	208,576.27	214,492.69

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 0.20% 的年托管费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年托管费率} / \text{当年天数}$$

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

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 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	366,320.09	1,512.15	233,260.24	896.80
合计	366,320.09	1,512.15	233,260.24	896.80

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行约定利率计息。

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（2024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 2024 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 50,016,329.35 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
092280086	22 农行永续债 02	2024 年 7 月 3 日	105.63	100,000	10,562,868.85
102380170	23 海淀国资 MTN001	2024 年 7 月 3 日	105.38	100,000	10,537,672.13
2120089	21 北京银行永续债 01	2024 年 7 月 3 日	107.90	100,000	10,790,409.84
2120107	21 浙商银行永续债	2024 年 7 月 3 日	106.14	100,000	10,614,453.55
2128045	21 中国银行永续债 02	2024 年 7 月 3 日	105.66	11,000	1,162,266.61
2128047	21 招商银行永续债	2024 年 7 月 3 日	105.73	100,000	10,572,957.38
合计				511,000	54,240,628.36

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2024 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 25,902,239.76 元，于 2024 年 7 月 4 日前先后到期。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中国建设银行，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 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	11,605,787.26	11,503,580.28
合计	11,605,787.26	11,503,580.28

注：未评级部分为国债。

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 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	111,147,271.52	101,310,052.50
AAA 以下	44,536,987.29	24,501,744.99
未评级	77,814,170.79	111,697,207.88
合计	233,498,429.60	237,509,005.37

注：未评级部分为国债和中期票据。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金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 2024 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额中有 75,918,569.11 元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同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发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(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该比例限制)。

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，部分基金资产流动暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。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 2024 年 6 月 30 日，本基金主动投资的流动性受限的资产的估值占基金资产净值的比例符合上述要求。

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 2024 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 2024年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	366,276.22	-	-	43.87	366,320.09
结算备付金	1,844,951.08	-	-	747.18	1,845,698.26
存出保证金	13,485.06	-	-	5.40	13,490.46
交易性金融资产	11,514,750.00	220,256,879.71	9,998,042.63	44,280,219.81	286,049,892.15
应收申购款	-	-	-	701.54	701.54
应收清算款	-	-	-	203,399.50	203,399.50
资产总计	13,739,462.36	220,256,879.71	9,998,042.63	44,485,117.30	288,479,502.00
负债					
应付赎回款	-	-	-	175.58	175.58
应付管理人报酬	-	-	-	130,415.27	130,415.27
应付托管费	-	-	-	34,777.41	34,777.41
应付清算款	-	-	-	304,005.50	304,005.50
卖出回购金融资产款	75,899,525.00	-	-	19,044.11	75,918,569.11
应交税费	-	-	-	1,215,330.61	1,215,330.61
其他负债	-	-	-	137,976.61	137,976.61
负债总计	75,899,525.00	-	-	1,841,725.09	77,741,250.09
利率敏感度缺口	-62,160,062.64	220,256,879.71	9,998,042.63	42,643,392.21	210,738,251.91
上年度末 2023年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	421,303.16	-	-	484.89	421,788.05
结算备付金	2,250,622.73	-	-	1,012.80	2,251,635.53
存出保证金	20,274.80	-	-	9.20	20,284.00
交易性金融资产	14,482,890.00	221,562,034.84	10,594,322.01	35,497,095.85	282,136,342.70
买入返售金融资产	500,000.00	-	-	460.26	500,460.26
应收申购款	-	-	-	1,546.46	1,546.46
应收清算款	-	-	-	165,584.14	165,584.14
资产总计	17,675,090.69	221,562,034.84	10,594,322.01	35,666,193.60	285,497,641.14
负债					
应付赎回款	-	-	-	397.66	397.66
应付管理人报酬	-	-	-	131,698.91	131,698.91
应付托管费	-	-	-	35,119.71	35,119.71
应付清算款	-	-	-	159,044.21	159,044.21
卖出回购金融资产款	75,599,725.00	-	-	37,403.10	75,637,128.10
应交税费	-	-	-	1,216,763.25	1,216,763.25
其他负债	-	-	-	276,726.56	276,726.56
负债总计	75,599,725.00	-	-	1,857,153.40	77,456,878.40
利率敏感度缺口	-57,924,634.31	221,562,034.84	10,594,322.01	33,809,040.20	208,040,762.74

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		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	1. 市场利率下降 25 个基点	1,340,208.19	1,616,797.53
2. 市场利率上升 25 个基点	-1,340,208.19	-1,616,797.53	

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股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于债券等固定收益类资产(含可转换债券)的比例不低于基金资产的 80%；投资于股票、权证等权益类证券的比例不超过基金资产的 20%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	40,945,675.29	19.43	33,123,757.05	15.92
合计	40,945,675.29	19.43	33,123,757.05	15.92

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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	80,357,795.37	55,824,908.09
第二层次	205,692,096.78	226,311,434.61
第三层次	-	-
合计	286,049,892.15	282,136,342.70

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。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2024 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(2023 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	40,945,675.29	14.19
	其中：股票	40,945,675.29	14.19
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	245,104,216.86	84.96
	其中：债券	245,104,216.86	84.96
	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	2,212,018.35	0.77
8	其他各项资产	217,591.50	0.08
9	合计	288,479,502.00	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**

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	400,342.00	0.19
B	采矿业	6,181,119.00	2.93
C	制造业	20,677,513.83	9.81
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,217,213.00	1.05
E	建筑业	591,225.00	0.28
F	批发和零售业	71,421.00	0.03

G	交通运输、仓储和邮政业	1,545,893.36	0.73
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,432,149.50	1.63
J	金融业	5,177,072.60	2.46
K	房地产业	175,380.00	0.08
L	租赁和商务服务业	239,175.00	0.11
M	科学研究和技术服务业	162,867.00	0.08
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	74,304.00	0.04
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	40,945,675.29	19.43

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	1,080	1,584,781.20	0.75
2	600941	中国移动	13,000	1,397,500.00	0.66
3	601225	陕西煤业	50,000	1,288,500.00	0.61
4	600036	招商银行	37,000	1,265,030.00	0.60
5	300750	宁德时代	6,560	1,180,996.80	0.56
6	601899	紫金矿业	67,000	1,177,190.00	0.56
7	600900	长江电力	40,000	1,156,800.00	0.55
8	000333	美的集团	15,500	999,750.00	0.47
9	601318	中国平安	23,060	953,761.60	0.45
10	002594	比亚迪	3,300	825,825.00	0.39
11	600028	中国石化	129,000	815,280.00	0.39
12	000858	五粮液	6,000	768,240.00	0.36
13	601919	中远海控	45,000	697,050.00	0.33
14	600276	恒瑞医药	17,000	653,820.00	0.31
15	300442	润泽科技	25,000	598,750.00	0.28
16	601398	工商银行	105,000	598,500.00	0.28
17	600188	兖矿能源	26,000	590,980.00	0.28
18	603296	华勤技术	10,000	552,300.00	0.26
19	688575	亚辉龙	22,000	513,040.00	0.24
20	002475	立讯精密	13,000	511,030.00	0.24
21	600150	中国船舶	12,000	488,520.00	0.23

22	601600	中国铝业	61,500	469,245.00	0.22
23	601328	交通银行	60,000	448,200.00	0.21
24	601985	中国核电	42,000	447,720.00	0.21
25	000063	中兴通讯	16,000	447,520.00	0.21
26	600309	万华化学	5,500	444,730.00	0.21
27	300308	中际旭创	3,200	441,216.00	0.21
28	600938	中国海油	13,000	429,000.00	0.20
29	300760	迈瑞医疗	1,230	357,819.30	0.17
30	603979	金诚信	7,000	353,710.00	0.17
31	600547	山东黄金	12,000	328,560.00	0.16
32	601857	中国石油	31,200	321,984.00	0.15
33	600031	三一重工	18,000	297,000.00	0.14
34	600489	中金黄金	20,000	296,000.00	0.14
35	601728	中国电信	46,000	282,900.00	0.13
36	600406	国电南瑞	11,000	274,560.00	0.13
37	000651	格力电器	7,000	274,540.00	0.13
38	601138	工业富联	10,000	274,000.00	0.13
39	601088	中国神华	6,000	266,220.00	0.13
40	688008	澜起科技	4,500	257,220.00	0.12
41	600887	伊利股份	9,800	253,232.00	0.12
42	601816	京沪高铁	45,000	241,650.00	0.11
43	002714	牧原股份	5,500	239,800.00	0.11
44	000725	京东方 A	57,400	234,766.00	0.11
45	688041	海光信息	3,300	232,056.00	0.11
46	600183	生益科技	11,000	231,660.00	0.11
47	300059	东方财富	21,000	221,760.00	0.11
48	600426	华鲁恒升	8,030	213,919.20	0.10
49	601288	农业银行	49,000	213,640.00	0.10
50	600690	海尔智家	7,500	212,850.00	0.10
51	600809	山西汾酒	1,000	210,880.00	0.10
52	300124	汇川技术	4,000	205,200.00	0.10
53	002241	歌尔股份	10,000	195,100.00	0.09
54	002371	北方华创	600	191,934.00	0.09
55	300274	阳光电源	2,800	173,684.00	0.08
56	000568	泸州老窖	1,200	172,188.00	0.08
57	603993	洛阳钼业	20,000	170,000.00	0.08
58	002466	天齐锂业	5,500	164,505.00	0.08
59	600741	华域汽车	10,000	163,800.00	0.08
60	300498	温氏股份	8,100	160,542.00	0.08
61	601668	中国建筑	30,000	159,300.00	0.08
62	688256	寒武纪	800	158,936.00	0.08
63	000938	紫光股份	7,000	156,450.00	0.07
64	601658	邮储银行	30,000	152,100.00	0.07

65	688036	传音控股	1,960	150,018.40	0.07
66	600795	国电电力	25,000	149,750.00	0.07
67	601601	中国太保	5,300	147,658.00	0.07
68	600600	青岛啤酒	2,000	145,540.00	0.07
69	002027	分众传媒	24,000	145,440.00	0.07
70	603019	中科曙光	3,500	145,250.00	0.07
71	000792	盐湖股份	8,300	144,835.00	0.07
72	601766	中国中车	18,600	139,686.00	0.07
73	688981	中芯国际	3,020	139,222.00	0.07
74	600050	中国联通	29,600	139,120.00	0.07
75	603392	万泰生物	2,100	138,348.00	0.07
76	002916	深南电路	1,300	137,501.00	0.07
77	002352	顺丰控股	3,800	135,622.00	0.06
78	601689	拓普集团	2,520	135,097.20	0.06
79	000338	潍柴动力	8,300	134,792.00	0.06
80	603986	兆易创新	1,400	133,868.00	0.06
81	601169	北京银行	21,700	126,728.00	0.06
82	601012	XD 隆基绿	9,000	126,180.00	0.06
83	300033	同花顺	1,200	124,440.00	0.06
84	600048	保利发展	14,000	122,640.00	0.06
85	000425	徐工机械	17,000	121,550.00	0.06
86	600660	福耀玻璃	2,500	119,750.00	0.06
87	002230	科大讯飞	2,700	115,965.00	0.06
88	601229	上海银行	15,300	111,078.00	0.05
89	603501	韦尔股份	1,100	109,307.00	0.05
90	601006	大秦铁路	15,071	107,908.36	0.05
91	000625	长安汽车	7,900	106,097.00	0.05
92	601390	中国中铁	16,000	104,320.00	0.05
93	601009	南京银行	10,000	103,900.00	0.05
94	600436	片仔癀	500	103,585.00	0.05
95	000157	中联重科	13,000	99,840.00	0.05
96	603259	药明康德	2,500	97,975.00	0.05
97	601888	中国中免	1,500	93,735.00	0.04
98	601211	国泰君安	6,900	93,495.00	0.04
99	002415	海康威视	3,000	92,730.00	0.04
100	003816	中国广核	20,000	92,600.00	0.04
101	601818	光大银行	28,400	90,028.00	0.04
102	688012	中微公司	630	88,993.80	0.04
103	600019	宝钢股份	13,000	86,450.00	0.04
104	600584	长电科技	2,700	85,617.00	0.04
105	601872	招商轮船	10,000	84,500.00	0.04
106	600886	国投电力	4,600	83,904.00	0.04
107	002304	洋河股份	1,000	80,740.00	0.04

108	688111	金山办公	340	77,350.00	0.04
109	600958	东方证券	10,100	76,760.00	0.04
110	600845	宝信软件	2,400	76,632.00	0.04
111	600438	通威股份	4,000	76,440.00	0.04
112	300014	亿纬锂能	1,900	75,848.00	0.04
113	688772	珠海冠宇	5,000	74,500.00	0.04
114	300015	爱尔眼科	7,200	74,304.00	0.04
115	002271	东方雨虹	6,000	74,040.00	0.04
116	601669	中国电建	13,200	73,788.00	0.04
117	605117	德业股份	980	72,853.20	0.03
118	300896	爱美客	420	72,282.00	0.03
119	600674	川投能源	3,800	71,250.00	0.03
120	000001	平安银行	7,000	71,050.00	0.03
121	600346	恒力石化	5,000	69,750.00	0.03
122	002920	德赛西威	800	69,672.00	0.03
123	600989	宝丰能源	4,000	69,320.00	0.03
124	600016	民生银行	18,100	68,599.00	0.03
125	600760	中航沈飞	1,700	68,170.00	0.03
126	600111	北方稀土	3,900	67,080.00	0.03
127	002050	三花智控	3,500	66,780.00	0.03
128	600104	上汽集团	4,800	66,528.00	0.03
129	002142	宁波银行	3,000	66,180.00	0.03
130	688271	联影医疗	600	65,820.00	0.03
131	600011	华能国际	6,800	65,416.00	0.03
132	601881	中国银河	6,000	65,160.00	0.03
133	605499	东鹏饮料	300	64,725.00	0.03
134	000596	古井贡酒	300	63,321.00	0.03
135	000983	山西焦煤	6,000	61,860.00	0.03
136	300408	三环集团	2,100	61,299.00	0.03
137	600009	上海机场	1,900	61,275.00	0.03
138	002311	海大集团	1,300	61,165.00	0.03
139	601186	中国铁建	7,000	59,990.00	0.03
140	002236	大华股份	3,800	58,748.00	0.03
141	000977	浪潮信息	1,600	58,192.00	0.03
142	300433	蓝思科技	3,100	56,575.00	0.03
143	600176	中国巨石	5,000	55,250.00	0.03
144	601377	兴业证券	10,600	53,636.00	0.03
145	601111	中国国航	7,200	53,136.00	0.03
146	001979	招商蛇口	6,000	52,740.00	0.03
147	002049	紫光国微	1,000	52,600.00	0.02
148	002555	三七互娱	4,030	52,591.50	0.02
149	002938	鹏鼎控股	1,300	51,688.00	0.02
150	600029	南方航空	8,500	50,065.00	0.02

151	600060	海信视像	2,000	49,480.00	0.02
152	601800	中国交建	5,500	49,170.00	0.02
153	600010	包钢股份	34,700	48,580.00	0.02
154	002601	龙佰集团	2,600	48,282.00	0.02
155	300122	智飞生物	1,700	47,651.00	0.02
156	000786	北新建材	1,600	47,456.00	0.02
157	601117	XD 中国化	5,700	46,968.00	0.02
158	603799	华友钴业	2,100	46,473.00	0.02
159	002493	荣盛石化	4,800	46,368.00	0.02
160	603369	今世缘	1,000	46,200.00	0.02
161	002179	中航光电	1,200	45,660.00	0.02
162	601838	成都银行	3,000	45,570.00	0.02
163	601021	春秋航空	800	45,064.00	0.02
164	600023	浙能电力	6,200	44,082.00	0.02
165	002180	纳思达	1,600	42,272.00	0.02
166	601360	三六零	5,500	42,240.00	0.02
167	600196	复星医药	1,900	42,066.00	0.02
168	600085	同仁堂	1,100	42,031.00	0.02
169	601868	中国能建	19,800	41,976.00	0.02
170	601100	恒立液压	900	41,922.00	0.02
171	600219	南山铝业	11,000	41,910.00	0.02
172	300661	圣邦股份	500	41,390.00	0.02
173	600893	航发动力	1,100	40,205.00	0.02
174	601336	新华保险	1,300	39,039.00	0.02
175	000963	华东医药	1,400	38,934.00	0.02
176	300347	泰格医药	800	38,880.00	0.02
177	300782	卓胜微	500	38,870.00	0.02
178	600570	恒生电子	2,200	38,852.00	0.02
179	002709	天赐材料	2,200	38,632.00	0.02
180	000895	双汇发展	1,600	38,032.00	0.02
181	601898	中煤能源	3,000	37,440.00	0.02
182	601238	广汽集团	4,800	37,152.00	0.02
183	600875	东方电气	2,000	36,900.00	0.02
184	600132	重庆啤酒	600	36,420.00	0.02
185	300751	迈为股份	300	35,844.00	0.02
186	688126	沪硅产业	2,513	34,704.53	0.02
187	601618	中国中冶	11,100	34,410.00	0.02
188	601877	正泰电器	1,800	34,308.00	0.02
189	601799	星宇股份	300	33,612.00	0.02
190	002459	晶澳科技	3,000	33,600.00	0.02
191	000999	华润三九	780	33,212.40	0.02
192	601607	上海医药	1,700	32,487.00	0.02
193	600332	白云山	1,100	32,263.00	0.02

194	600588	用友网络	3,200	32,000.00	0.02
195	000876	新希望	3,500	31,990.00	0.02
196	600026	中远海能	2,000	31,220.00	0.01
197	600803	新奥股份	1,500	31,200.00	0.01
198	300454	深信服	600	30,318.00	0.01
199	600025	华能水电	2,800	30,184.00	0.01
200	688396	华润微	800	29,952.00	0.01
201	300628	亿联网络	800	29,416.00	0.01
202	000408	藏格矿业	1,200	28,884.00	0.01
203	002648	卫星化学	1,600	28,768.00	0.01
204	300316	晶盛机电	1,000	28,730.00	0.01
205	600585	海螺水泥	1,200	28,308.00	0.01
206	600745	闻泰科技	1,000	28,250.00	0.01
207	300223	北京君正	500	27,720.00	0.01
208	000661	长春高新	300	27,531.00	0.01
209	300496	中科创达	600	27,354.00	0.01
210	300999	金龙鱼	1,000	27,350.00	0.01
211	601699	潞安环能	1,500	27,195.00	0.01
212	000807	云铝股份	2,000	27,020.00	0.01
213	002007	华兰生物	1,700	26,843.00	0.01
214	002821	凯莱英	400	26,320.00	0.01
215	300919	中伟股份	840	26,031.60	0.01
216	300759	康龙化成	1,400	26,012.00	0.01
217	688082	盛美上海	300	25,353.00	0.01
218	601319	中国人保	4,900	25,235.00	0.01
219	300413	芒果超媒	1,200	25,080.00	0.01
220	000733	振华科技	600	24,918.00	0.01
221	600018	上港集团	4,300	24,854.00	0.01
222	301269	华大九天	300	23,115.00	0.01
223	603195	公牛集团	290	22,364.80	0.01
224	002812	恩捷股份	700	22,155.00	0.01
225	688223	晶科能源	3,090	21,939.00	0.01
226	000708	中信特钢	1,600	21,712.00	0.01
227	600039	四川路桥	2,700	21,303.00	0.01
228	600027	华电国际	3,000	20,820.00	0.01
229	601865	福莱特	1,000	20,100.00	0.01
230	002603	以岭药业	1,300	19,929.00	0.01
231	603659	璞泰来	1,400	19,782.00	0.01
232	688187	时代电气	400	19,752.00	0.01
233	601698	中国卫通	1,400	19,726.00	0.01
234	002410	广联达	2,000	19,160.00	0.01
235	603806	福斯特	1,260	18,522.00	0.01
236	600905	三峡能源	4,200	18,312.00	0.01

237	300979	华利集团	300	18,255.00	0.01
238	600460	士兰微	1,000	17,510.00	0.01
239	601808	中海油服	1,000	17,200.00	0.01
240	688363	华熙生物	300	16,971.00	0.01
241	601628	中国人寿	500	15,525.00	0.01
242	300957	贝泰妮	300	14,496.00	0.01
243	603288	海天味业	400	13,788.00	0.01
244	000301	东方盛虹	1,600	12,752.00	0.01
245	000768	中航西飞	400	9,612.00	0.00
246	600115	中国东航	1,900	7,619.00	0.00
247	601633	长城汽车	300	7,590.00	0.00
248	002129	TCL 中环	700	6,055.00	0.00
249	001965	招商公路	500	5,930.00	0.00
250	688599	天合光能	320	5,414.40	0.00
251	603833	欧派家居	100	5,356.00	0.00
252	001289	龙源电力	300	5,175.00	0.00
253	300450	先导智能	300	4,989.00	0.00
254	603260	合盛硅业	100	4,671.00	0.00
255	000800	一汽解放	400	3,132.00	0.00
256	603899	晨光股份	100	3,128.00	0.00
257	600372	中航机载	100	1,197.00	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	1,533,994.00	0.74
2	600036	招商银行	1,099,586.00	0.53
3	300442	润泽科技	993,565.00	0.48
4	601318	中国平安	988,444.00	0.48
5	300750	宁德时代	977,210.00	0.47
6	600028	中国石化	939,021.00	0.45
7	601919	中远海控	927,184.00	0.45
8	600941	中国移动	884,620.00	0.43
9	000333	美的集团	878,423.00	0.42
10	000858	五粮液	784,067.00	0.38
11	000063	中兴通讯	775,589.00	0.37
12	600276	恒瑞医药	742,624.60	0.36
13	600820	隧道股份	666,130.00	0.32
14	002594	比亚迪	640,298.00	0.31
15	600188	兖矿能源	632,159.00	0.30
16	002241	歌尔股份	576,409.00	0.28
17	300624	万兴科技	544,627.00	0.26

18	601398	工商银行	543,625.00	0.26
19	601225	陕西煤业	523,270.00	0.25
20	002738	中矿资源	452,622.00	0.22

7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000933	神火股份	1,921,485.00	0.92
2	002475	立讯精密	1,462,964.00	0.70
3	300760	迈瑞医疗	1,352,367.80	0.65
4	688008	澜起科技	1,313,608.80	0.63
5	603596	伯特利	1,240,980.62	0.60
6	603296	华勤技术	1,218,480.00	0.59
7	000034	神州数码	1,195,728.00	0.57
8	601006	大秦铁路	1,120,884.00	0.54
9	300624	万兴科技	1,120,416.00	0.54
10	002463	沪电股份	912,165.84	0.44
11	688262	国芯科技	900,979.91	0.43
12	300031	宝通科技	879,738.00	0.42
13	603658	安图生物	772,836.00	0.37
14	688047	龙芯中科	699,380.53	0.34
15	300567	精测电子	688,791.00	0.33
16	688088	虹软科技	683,276.42	0.33
17	600820	隧道股份	669,100.00	0.32
18	601225	陕西煤业	650,843.00	0.31
19	601689	拓普集团	596,585.00	0.29
20	688037	芯源微	561,454.51	0.27

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	38,422,030.66
卖出股票收入（成交）总额	29,191,798.18

注：本项中 7.4.1、7.4.2、7.4.3 表中的“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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	16,610,022.37	7.88
2	央行票据	-	-
3	金融债券	53,106,749.73	25.20
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	20,952,374.79	9.94

5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	115,022,949.89	54.58
7	可转债（可交换债）	39,412,120.08	18.70
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	245,104,216.86	116.31

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	2120089	21 北京银行永续债 01	100,000	10,790,409.84	5.12
2	102382878	23 中交天航 MTN002(科创票据)	100,000	10,675,045.90	5.07
3	2120107	21 浙商银行永续债	100,000	10,614,453.55	5.04
4	102383281	23 中建四局 MTN002(科创票据)	100,000	10,590,857.92	5.03
5	2128047	21 招商银行永续债	100,000	10,572,957.38	5.02

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

1、21 中国银行永续债 02

2023 年 12 月 1 日，银罚决字（2023）93 号显示，中国银行股份有限公司存在违反账户管理规定等 12 项违法违规事实，被处警告，没收违法所得 37.340315 万元，罚款 3,664.2 万元。2023 年 12 月 28 日，金罚决字（2023）68 号显示，中国银行股份有限公司存在部分重要信息系统识别不全面，灾备建设和灾难恢复能力不符合监管要求等 9 项违法违规事实，被处罚款 430 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、21 浙商银行永续债

2024 年 2 月 5 日，浙金罚决字（2024）4 号显示，浙商银行股份有限公司存在向小微企业客户转嫁成本，违规要求客户承担抵押评估费等 2 项违法违规事实，被处罚款 55 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、21 招商银行永续债

2023 年 11 月，招商银行因违反规定办理结汇、售汇业务行为、违反规定办理资本项目资金收付行为，被国家外汇管理局深圳市分局没收违法所得 89.03 万元，并罚款 475 万元。

2023 年 12 月 1 日，招商银行宁波分行因“为环保不达标企业办理贴现业务；违规收费；员工行为管理存在薄弱环节；房地产业务管理不审慎；个人经营性贷款用于置换按揭贷款；贷款“三查”不尽职；贸易背景真实性审查不到位；投后管理不尽职导致理财投资资金被挪用”，被国家金融监督管理总局宁波监管局合计罚款 285 万元，没收未退费的违法所得 1516.68 元。

2023 年 12 月 15 日，招商银行因“未按规定承担小微企业押品评估费；未按规定承担房屋抵押登记费；未落实价格目录，向小微企业收取委托贷款手续费；小微企业规模划型依据不足”，被国家金融监督管理总局深圳监管局罚款 160 万元。

2024 年 6 月 28 日，招商银行因“理财业务存在以下违法违规行为：一、未能有效穿透识别底层资产，二、信息披露不规范”，被国家金融监督管理总局罚款 350 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。

4、22 农行永续债 02

2023 年 8 月 15 日，金罚决字（2023）8 号显示，中国农业银行股份有限公司存在农户贷款发放后流入房地产企业等 19 项违法违规事实，被处没收违法所得并处罚款 4,420.184584 万元。2023 年 12 月 1 日，金罚决字（2023）21 号显示，中国农业银行股份有限公司存在流动资金贷款被用于固定资产投资等 13 项违法违规事实，没收违法所得并处罚款合计 2,710.9738 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。

5、21 北京银行永续债 01

2024 年 2 月 6 日，京金罚决字（2024）3 号显示，北京银行股份有限公司存在 EAST 信贷业务数据漏报等 10 项违法违规事实，被罚款 330 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。

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。

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

基金投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

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	13,490.46
2	应收清算款	203,399.50
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	701.54
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	217,591.50

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	127049	希望转 2	4,242,570.56	2.01
2	127045	牧原转债	1,834,414.81	0.87
3	123076	强力转债	1,748,743.01	0.83
4	127022	恒逸转债	1,226,502.90	0.58
5	127068	顺博转债	1,215,342.24	0.58
6	113639	华正转债	1,175,985.59	0.56
7	113656	嘉诚转债	1,115,956.44	0.53
8	118024	冠宇转债	1,096,539.73	0.52
9	113641	华友转债	1,014,670.14	0.48
10	123132	回盛转债	995,595.89	0.47
11	123128	首华转债	990,645.75	0.47
12	123193	海能转债	790,999.32	0.38
13	123159	崧盛转债	759,524.93	0.36
14	113653	永 22 转债	702,763.44	0.33
15	113644	艾迪转债	689,016.11	0.33
16	118033	华特转债	670,630.68	0.32
17	123234	中能转债	648,591.29	0.31

18	123190	道氏转 02	646,122.05	0.31
19	111004	明新转债	637,583.01	0.30
20	113679	芯能转债	637,338.41	0.30
21	113047	旗滨转债	603,085.55	0.29
22	113636	甬金转债	569,503.42	0.27
23	113652	伟 22 转债	565,557.95	0.27
24	127091	科数转债	565,025.75	0.27
25	128105	长集转债	564,890.99	0.27
26	113049	长汽转债	564,624.45	0.27
27	113606	荣泰转债	557,110.96	0.26
28	111010	立昂转债	553,354.79	0.26
29	118015	芯海转债	536,146.58	0.25
30	123108	乐普转 2	531,228.77	0.25
31	127075	百川转 2	509,997.26	0.24
32	113033	利群转债	508,295.07	0.24
33	127031	洋丰转债	506,259.86	0.24
34	123169	正海转债	497,273.23	0.24
35	127052	西子转债	485,961.26	0.23
36	128109	楚江转债	443,306.08	0.21
37	110093	神马转债	442,015.23	0.21
38	113638	台 21 转债	347,489.19	0.16
39	123147	中辰转债	346,213.07	0.16
40	123117	健帆转债	340,338.90	0.16
41	123133	佩蒂转债	338,995.89	0.16
42	118030	睿创转债	332,131.64	0.16
43	128142	新乳转债	323,403.29	0.15
44	118042	奥维转债	317,107.40	0.15
45	127099	盛航转债	285,015.27	0.14
46	127085	韵达转债	275,252.53	0.13
47	110062	烽火转债	258,505.36	0.12
48	123185	能辉转债	246,721.58	0.12
49	123212	立中转债	235,005.81	0.11
50	127066	科利转债	218,184.66	0.10
51	123174	精锻转债	214,998.08	0.10
52	127042	嘉美转债	211,229.04	0.10
53	127076	中宠转 2	203,936.94	0.10
54	123216	科顺转债	190,735.29	0.09
55	127101	豪鹏转债	182,963.38	0.09
56	110082	宏发转债	167,578.77	0.08
57	123115	捷捷转债	166,103.42	0.08
58	123233	凯盛转债	162,590.71	0.08
59	127077	华宏转债	139,036.85	0.07
60	123121	帝尔转债	113,503.29	0.05

61	123211	阳谷转债	110,752.90	0.05
62	111013	新港转债	95,100.82	0.05
63	127015	希望转债	42,463.09	0.02
64	127074	麦米转 2	5,995.30	0.00

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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

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 (%)
1,208	150,789.28	167,254,407.51	91.82	14,899,040.26	8.18

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	0.00	0.0000

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	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2008 年 10 月 8 日) 基金份额总额	1,362,144,547.24
本报告期期初基金份额总额	182,586,890.85
本报告期基金总申购份额	93,215.52
减：本报告期基金总赎回份额	526,658.60
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	182,153,447.77

§ 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

本报告期本基金管理人的高级管理人员无重大人事变动。

10.2.2 基金经理变动情况

本报告期本基金基金经理未曾变动。

10.2.3 本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动情况

本报告期内，本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

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，管理人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

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，基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

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 (%)	
红塔证券	1	40,008,845.42	59.48	37,844.52	59.48	-

海通证券	1	27,252,896.74	40.52	25,778.48	40.52	-
招商证券	1	-	-	-	-	-

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
红塔证券	107,310,433.95	60.73	1,769,740,000.00	97.64	-	-
海通证券	69,404,528.58	39.27	42,700,000.00	2.36	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-

注：1、本公司选择证券经营机构的标准

(1) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时为本公司提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告等，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

(2) 财力雄厚，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、基金交易单元的选择程序如下：

(1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构。

(2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

3、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：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旗下基金 2023 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会指定披露媒介	2024 年 1 月 20 日
2	长盛积极配置债券型证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	中国证监会指定披露媒介	2024 年 1 月 20 日

3	长盛基金管理有限公司关于旗下基金增加江苏银行为代销机构的公告	中国证监会指定披露媒介	2024 年 3 月 6 日
4	长盛积极配置债券型证券投资基金 2023 年年度报告	中国证监会指定披露媒介	2024 年 3 月 30 日
5	长盛基金管理有限公司旗下基金 2023 年年度报告提示性公告	中国证监会指定披露媒介	2024 年 3 月 30 日
6	长盛积极配置债券型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定披露媒介	2024 年 4 月 19 日
7	长盛积极配置债券型证券投资基金招募说明书（更新）	中国证监会指定披露媒介	2024 年 4 月 19 日
8	长盛基金管理有限公司旗下基金 2024 年 1 季度报告提示性公告	中国证监会指定披露媒介	2024 年 4 月 20 日
9	长盛积极配置债券型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	中国证监会指定披露媒介	2024 年 4 月 20 日
10	长盛积极配置债券型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定披露媒介	2024 年 6 月 25 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	20240101~20240630	138,618,658.16	0.00	0.00	138,618,658.16	76.10
产品特有风险							
<p>本基金本报告期存在单一投资者持有基金份额比例超过 20%的情况，当该基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致的风险包括：巨额赎回风险、流动性风险、基金资产净值持续低于 5000 万元的风险、基金份额净值大幅波动风险以及基金收益水平波动风险。本基金管理人将对申购赎回进行审慎的应对，保护中小投资者利益。</p>							

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、长盛积极配置债券型证券投资基金相关批准文件；
- 2、《长盛积极配置债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长盛积极配置债券型证券投资基金托管协议》；

- 4、《长盛积极配置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

2024年8月30日