

长盛悦鑫 60 天持有期纯债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：中信银行股份有限公司

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。

基金托管人中信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 03 月 05 日（基金合同生效日）起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	14
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>14</b>
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	18
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>39</b>
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
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	40
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	40
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	41

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 .....	41
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 .....	41
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 .....	41
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	41
7.11 投资组合报告附注 .....	41
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>42</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	42
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	43
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 .....	43
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>43</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>44</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	44
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 .....	44
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	44
10.4 基金投资策略的改变 .....	44
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	44
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 .....	45
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	45
10.8 其他重大事件 .....	45
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>46</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	46
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	46
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>47</b>
12.1 备查文件目录 .....	47
12.2 存放地点 .....	47
12.3 查阅方式 .....	47

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	长盛悦鑫 60 天持有期纯债债券型证券投资基金	
基金简称	长盛悦鑫 60 天持有纯债	
基金主代码	020548	
基金运作方式	本基金为契约型开放式，但对每份基金份额设置 60 天的最短持有期限	
基金合同生效日	2024 年 3 月 5 日	
基金管理人	长盛基金管理有限公司	
基金托管人	中信银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	264,280,781.57 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	长盛悦鑫 60 天持有纯债 A	长盛悦鑫 60 天持有纯债 C
下属分级基金的交易代码	020548	020549
报告期末下属分级基金的份额总额	42,064,545.97 份	222,216,235.60 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险和保持较高流动性的基础上，力求获得超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	<p>(一) 大类资产配置</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>1、利率策略：利率策略主要是从组合久期及组合期限结构两个方向制定针对市场利率因素的投资策略。</p> <p>2、类属配置策略：债券类属策略主要是通过研究国民经济运行状况，货币市场及资本市场资金供求关系，以及不同时期市场投资热点，分析国债、金融债、企业债、公司债等不同债券种类的利差水平，评定不同债券类属的相对投资价值，确定组合资产在不同债券类属之间配置比例。</p> <p>3、信用策略：信用品种的选择采取以利率研究和发行人偿债能力研究为核心的分析方式，在对宏观经济、利率走势、发行人经营及财务状况进行分析的基础上，结合信用品种的发行条款，建立信用债备选库，并以此为基础拟定信用品种的投资方法。</p> <p>4、相对价值策略：本基金认为市场存在着失效的现象，短期因素的影响被过分夸大。债券市场的参与者众多，投资行为、风险偏好、财务与税收处理等各不相同，发掘存在于这些不同因素之间的相对</p>

	<p>价值，也是本基金发现投资机会的重要方面。</p> <p>5、债券选择策略：根据单个债券到期收益率相对于市场收益率曲线的偏离程度，结合其信用等级、流动性、选择权条款、税赋特点等因素，确定其投资价值，选择那些定价合理或价值被低估的债券进行投资。</p> <p>（三）国债期货投资策略</p> <p>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。基金管理人将充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征，运用国债期货对冲系统风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。</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	中信银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	张利宁	滕菲菲
	联系电话	010-86497608	4006800000
	电子邮箱	zhangln@csfunds.com.cn	tengfeifei@citicbank.com
客户服务电话		400-888-2666、010-86497888	95558
传真		010-86497999	010-85230024
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	北京市朝阳区光华路 10 号院 1 号楼 6-30 层、32-42 层
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	北京市朝阳区光华路 10 号院 1 号楼 6-30 层、32-42 层
邮政编码		100029	100020
法定代表人		胡甲	方合英

### 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	<a href="http://www.csfunds.com.cn">http://www.csfunds.com.cn</a>
基金中期报告备置地点	基金管理人和基金托管人的办公地址

### 2.5 其他相关资料

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

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数 据和指标	2024 年 3 月 5 日（基金合同生效日）-2024 年 6 月 30 日	
	长盛悦鑫 60 天持有纯债 A	长盛悦鑫 60 天持有纯债 C
本期已实现收益	740,332.61	4,465,437.28
本期利润	701,009.31	4,209,229.30
加权平均基金份 额本期利润	0.0106	0.0099
本期加权平均净 值利润率	1.06%	0.99%
本期基金份额净 值增长率	1.07%	1.00%
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	448,841.29	2,229,326.63
期末可供分配基 金份额利润	0.0107	0.0100
期末基金资产净 值	42,513,387.26	224,445,562.23
期末基金份额净 值	1.0107	1.0100
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	1.07%	1.00%

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 2024 年 3 月 5 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

长盛悦鑫 60 天持有纯债 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.26%	0.01%	0.65%	0.03%	-0.39%	-0.02%
过去三个月	0.94%	0.02%	1.06%	0.07%	-0.12%	-0.05%
自基金合同生效起至今	1.07%	0.02%	1.10%	0.07%	-0.03%	-0.05%

长盛悦鑫 60 天持有纯债 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.24%	0.01%	0.65%	0.03%	-0.41%	-0.02%
过去三个月	0.89%	0.02%	1.06%	0.07%	-0.17%	-0.05%
自基金合同生效起至今	1.00%	0.02%	1.10%	0.07%	-0.10%	-0.05%

注：本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程：

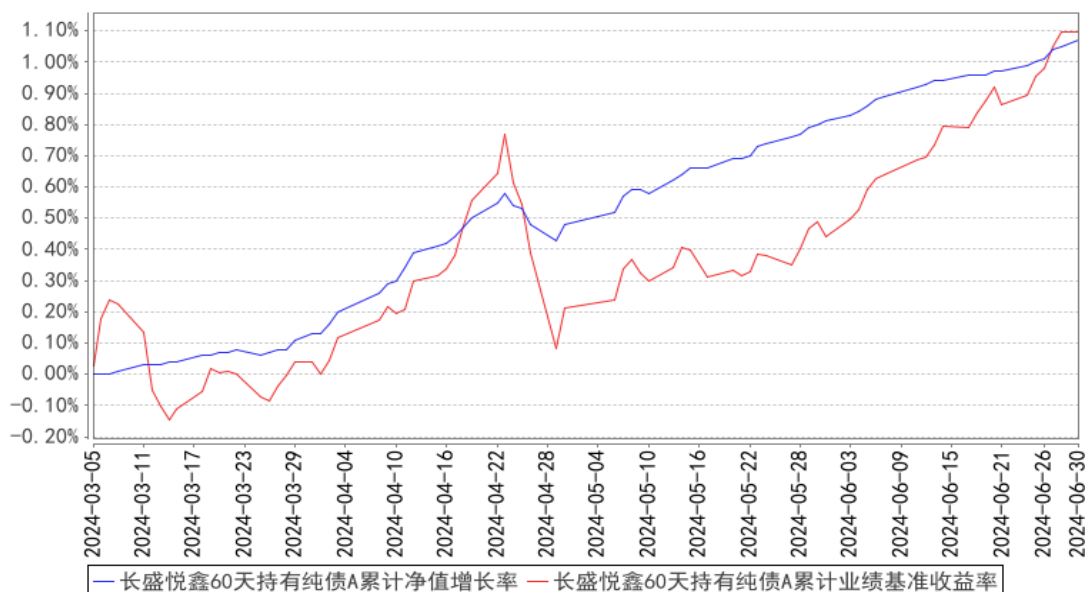
本基金业绩比较基准为：中债综合指数（全价）收益率

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。

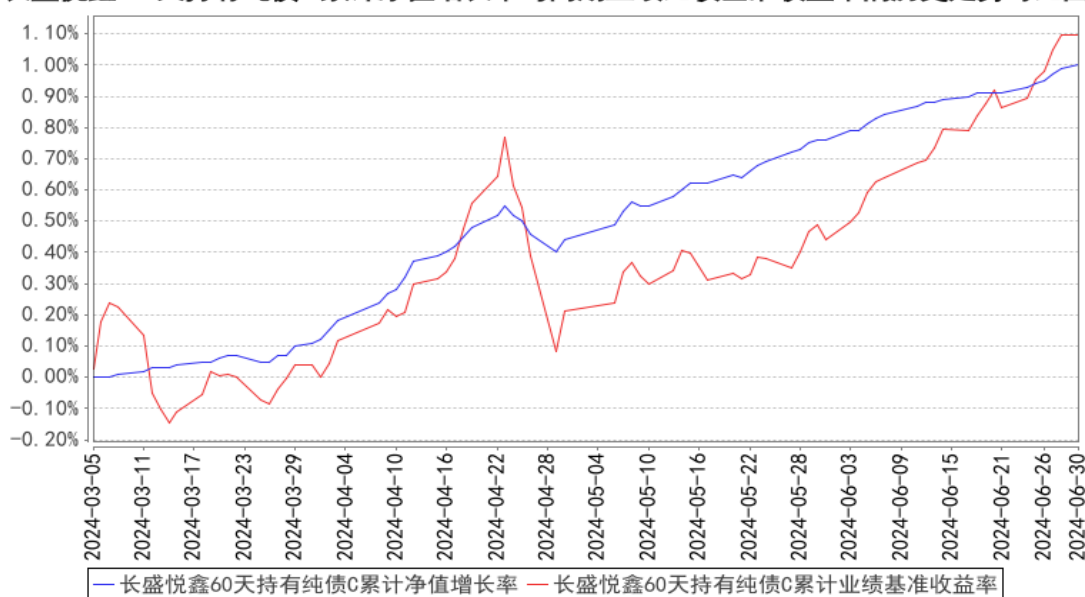


### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

**长盛悦鑫60天持有纯债A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图**



**长盛悦鑫60天持有纯债C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图**



注：1、本基金基金合同生效日为 2024 年 3 月 5 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，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有关约定。截止本报告期末仍处于建仓期。

3、本基金的投资组合比例为：本基金对债券的投资比例不低于基金资产的 80%；每个交易日日终，在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。国债期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。如法律法规或监管机构

以后允许基金投资其他品种或对投资比例要求有变更的，基金管理人在履行适当程序后，可以做出相应调整。

## § 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		
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，长盛盛康纯债债券型证券投资基金基金经理，长盛嘉鑫 30 天持有期纯债债券型证券投资基金基金经理，长盛利鑫	2024 年 3 月 5 日	-	11 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。

90 天持有期纯债 债券型证券投资 基金基金经理。				
---------------------------------	--	--	--	--

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，经济基本面偏弱，经济增长面临较大压力。房地产投资下滑，拖累经济增长，基建投资发力，但不及预期，制造业投资维持高速增长，对经济增长形成一定支撑，投资方面整体对经济增长形成拖累；消费增速下降，1-6 月份社会消费品零售总额累计同比增长 3.7%，社零走弱；出口表现较好，1-6 月份出口累计同比增长 3.6%，出口景气度较好。物价低位运行，CPI 在 0 附近徘徊，PPI 仍然负增，但跌幅缩窄。在防止资金空转、提升信贷效能的背景下，社融走弱，进入 4 月份，M1 连续负增长，存款向银行理财和公募基金搬家，进一步对社融增长形成拖累。

货币政策方面，央行维持稳健宽松的货币政策取向，在综合考虑汇率和利率风险的前提下，结合市场情况及时进行货币投放，平抑市场波动。上半年资金面整体较为稳定，资金价格处于低位，对债券市场形成呵护。

市场层面，受隐债化债影响，安全资产稀缺，“资产荒”逻辑主导债券市场投资，期限利差和信用利差压缩至历史低位。进入 4 月份，停止手工补息致使存款向银行理财和公募基金搬家，非银资金面宽松，整体对债券市场形成利好。上半年，债券市场呈现牛市行情，债券收益率快速下行，长久期债券受青睐，表现较为强势。

上半年，债券收益率整体呈现下行趋势。以 AA+ 中短期票据为例，1 年期收益率下行 51.17BP 至 2.1154%，3 年期收益率下行 61.59BP 至 2.2362%，5 年期收益率下行 80.62BP 至 2.3627%，收益率曲线平坦化。

#### 2、报告期内本基金投资策略分析

报告期内，本基金主要投资于流动性较好的中短期债券，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悦鑫 60 天持有纯债 A 的基金份额净值为 1.0107 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.07%，同期业绩比较基准收益率为 1.10%；截至本报告期末长盛悦鑫 60 天持有纯

债 C 的基金份额净值为 1.0100 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.00%，同期业绩比较基准收益率为 1.10%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，经济增长承压，稳汇率和防风险对货币政策进一步宽松有一定的掣肘。预计下半年，消费增长乏力，房地产投资依旧处于磨底阶段，基建投资对经济增长支持不足，出口有望维持高景气度，制造业投资增速依旧高增。整体看，经济下行压力明显，稳增长对政策的诉求较强。二季度 GDP 意外下滑，为完成全年经济增长目标，下半年经济增长压力较大。预计货币政策维持稳健宽松的总基调，在稳汇率和防风险的前提下，继续支持经济复苏向好，同时财政将加大投资力度，托底经济增长。

下半年，债券市场大概率维持低利率的市场环境，短期内“资产荒”难以有效缓解，投资者对安全资产的配置需求依旧会是债券市场投资的主逻辑。在绝对收益偏低的行情下，久期或是最主要的超额收益来源，与此同时，监管机构对长端利率快速下行风险的关注，或加剧长端债券收益率的波动。

预计下半年债券市场大幅调整风险不大，哑铃策略或继续有效，在期限利差偏低的情形下，以短久期资产为基础配置，获取票息，同时配置长久期高流动性债券资产，兼顾票息的同时，积极参与波段操作获取资本利得。

在此背景下，结合本基金的定位，下半年我们将继续坚持短久期+息差收益策略，灵活调整组合久期，视市场情况积极把握中长端活跃券波段交易的机会，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

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

作为本基金的托管人，中信银行严格遵守了《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，对长盛悦鑫 60 天持有期纯债债券型证券投资基金 2024 年上半年的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，履行了托管人的义务，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

本托管人认为，长盛基金管理有限公司在长盛悦鑫 60 天持有期纯债债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，长盛基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的 2024 年中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

## § 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：长盛悦鑫 60 天持有期纯债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
<b>资产：</b>		
货币资金	6.4.7.1	163,311.26
结算备付金		-
存出保证金		1,901.23
交易性金融资产	6.4.7.2	323,260,039.30
其中：股票投资		-
基金投资		-
债券投资		323,260,039.30
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		754,962.52
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.8	-
资产总计		324,180,214.31
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024 年 6 月 30 日</b>
<b>负债：</b>		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		57,012,415.06
应付清算款		-
应付赎回款		10,106.06
应付管理人报酬		71,860.93
应付托管费		11,976.80
应付销售服务费		40,757.19
应付投资顾问费		-
应交税费		22,740.73

应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.9	51,408.05
负债合计		57,221,264.82
<b>净资产：</b>		
实收基金	6.4.7.10	264,280,781.57
其他综合收益	6.4.7.11	-
未分配利润	6.4.7.12	2,678,167.92
净资产合计		266,958,949.49
负债和净资产总计		324,180,214.31

注：1、报告截止日 2024 年 06 月 30 日，长盛悦鑫 60 天持有纯债 A 的基金份额净值为 1.0107 元，份额总额为 42,064,545.97 份；长盛悦鑫 60 天持有纯债 C 的基金份额净值为 1.0100 元，份额总额为 222,216,235.60 份。基金份额总额 264,280,781.57 份。

2、本基金合同于 2024 年 3 月 5 日生效，本报告期自 2024 年 3 月 5 日至 2024 年 6 月 30 日。

## 6.2 利润表

会计主体：长盛悦鑫 60 天持有期纯债债券型证券投资基金

本报告期：2024 年 3 月 5 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 3 月 5 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		6,272,194.69
1. 利息收入		635,489.38
其中：存款利息收入	6.4.7.13	45,922.06
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		589,567.32
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		5,932,236.59
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	5,932,236.59
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	-
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	-295,531.28
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	-
<b>减：二、营业总支出</b>		1,361,956.08
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	476,166.60
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	79,361.09
3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	274,817.79
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		487,509.24
其中：卖出回购金融资产支出		487,509.24
6. 信用减值损失	6. 4. 7. 22	-
7. 税金及附加		11,257.12
8. 其他费用	6. 4. 7. 23	32,844.24
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		4,910,238.61
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		4,910,238.61
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-
<b>六、综合收益总额</b>		4,910,238.61

注：本基金合同于 2024 年 3 月 5 日生效，本报告期自 2024 年 3 月 5 日至 2024 年 6 月 30 日。

### 6.3 净资产变动表

会计主体：长盛悦鑫 60 天持有期纯债债券型证券投资基金

本报告期：2024 年 3 月 5 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 3 月 5 日（基金合同生效日）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	-	-	-
二、本期期初净资产	634,463,529.33	-	634,463,529.33
三、本期增减变动额 （减少以“-”号填列）	-370,182,747.76	2,678,167.92	-367,504,579.84
（一）、综合收益总额	-	4,910,238.61	4,910,238.61
（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）	-370,182,747.76	-2,232,070.69	-372,414,818.45
其中：1. 基金申购款	8,930,577.21	57,397.50	8,987,974.71
2. 基金赎回款	-379,113,324.97	-2,289,468.19	-381,402,793.16
（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	264,280,781.57	2,678,167.92	266,958,949.49

注：本基金合同于 2024 年 3 月 5 日生效，本报告期自 2024 年 3 月 5 日至 2024 年 6 月 30 日。

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

长盛悦鑫 60 天持有期纯债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[2023]2880 号《关于准予长盛悦鑫 60 天持有期纯债债券型证券投资基金注册的批复》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《长盛悦鑫 60 天持有期纯债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基金，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 634,284,622.60 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2024)第 0081 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《长盛悦鑫 60 天持有期纯债债券型证券投资基金基金合同》于 2024 年 3 月 5 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 634,463,529.33 份基金份额，其中认购资金利息折合 178,906.73 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，基金托管人为中信银行股份有限公司。

根据《长盛悦鑫 60 天持有期纯债债券型证券投资基金基金合同》和《长盛悦鑫 60 天持有期纯债债券型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金根据申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认购/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；在投资者认购/申购时不收取认购/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 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算并公告基金份额净值。本基金不同基金份额类别之间不得互相转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛悦鑫 60 天持有期纯债债券型证券投资基金

基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为固定收益类金融工具，具体包括：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、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金不投资于股票等权益类资产，也不投资于可转换债券(可分离交易可转债的纯债部分除外)、可交换债券。本基金投资组合中债券投资占基金资产的比例不低于 80%；在每个交易日日终，在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。国债期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为：中债综合指数(全价)收益率。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《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》、《长盛悦鑫 60 天持有期纯债债券型证券投资基金基金合同》和中国证监会、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 3 月 5 日(基金合同生效日)至 2024 年 6 月 30 日止期间的财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 年 3 月 5 日(基金合同生效日)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 重要会计政策和会计估计

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本财务报表的实际编制期间为 2024 年 3 月 5 日(基金合同生效日)至 2024 年 6 月 30 日。

##### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

#### (1) 金融资产

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

#### 债务工具

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

#### 以摊余成本计量：

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

#### 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

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

#### (2) 金融负债

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

#### (3) 衍生金融工具

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

#### 6.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

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

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

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的债券投资、资产支持证券投资和衍生工具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其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，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) 当金融工具不存在活跃市场，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。采用估值技术时，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，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。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认列。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。

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3) 该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别)，所有工具具有相同的特征(例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同)；(4) 除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工

具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5) 该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：(1) 现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括该基金或合同的任何影响)；(2) 实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现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损益占净资产比例计算的金额。未实现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损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，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

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息及在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

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

本基金同一类别的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净资产转出。

#### 6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。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)本基金的基金管理人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)本基金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。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别债券投资和资产支持证券的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司



所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 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[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

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

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。

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

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

## 6.4.7.1 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	163,311.26
等于：本金	163,234.67
加：应计利息	76.59
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	163,311.26

## 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	-	-	-	-	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	30,437,564.37	592,657.54	30,889,657.54	-140,564.37
	银行间市场	287,923,366.91	4,601,981.76	292,370,381.76	-154,966.91
	合计	318,360,931.28	5,194,639.30	323,260,039.30	-295,531.28
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	318,360,931.28	5,194,639.30	323,260,039.30	-295,531.28	

## 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 2024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	18,963.81
其中：交易所市场	-
银行间市场	18,963.81
应付利息	-
预提费用	32,444.24
合计	51,408.05

## 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

## 长盛悦鑫 60 天持有纯债 A

项目	本期 2024年3月5日（基金合同生效日）至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	80,351,631.23	80,351,631.23
本期申购	1,571,535.47	1,571,535.47
本期赎回（以“-”号填列）	-39,858,620.73	-39,858,620.73
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	42,064,545.97	42,064,545.97

## 长盛悦鑫 60 天持有纯债 C

项目	本期 2024 年 3 月 5 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	554,111,898.10	554,111,898.10
本期申购	7,359,041.74	7,359,041.74
本期赎回（以“-”号填列）	-339,254,704.24	-339,254,704.24
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	222,216,235.60	222,216,235.60

注：1、本基金合同生效日为 2024 年 3 月 5 日。

2、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 80,336,132.73 元，折合 80,336,132.73 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 15,498.50 元，折合 15,498.50 份 A 类基金份额；以上确认的实收基金共计人民币 80,351,631.23 元，折合 80,351,631.23 份 A 类基金份额。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 553,948,489.87 元，折合 553,948,489.87 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 163,408.23 元，折合 163,408.23 份 C 类基金份额；以上确认的实收基金共计人民币 554,111,898.10 元，折合 554,111,898.10 份 C 类基金份额。A 类基金份额和 C 类基金份额确认的实收基金合计人民币 634,463,529.33 元，分别折合成 A 类及 C 类基金份额，合计折合 634,463,529.33 份基金份额。

3、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

长盛悦鑫 60 天持有纯债 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	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	740,332.61	-39,323.30	701,009.31
本期基金份额交易产生的变动数	-269,542.68	17,374.66	-252,168.02
其中：基金申购款	8,724.31	-79.66	8,644.65
基金赎回款	-278,266.99	17,454.32	-260,812.67
本期已分配利润	-	-	-
本期末	470,789.93	-21,948.64	448,841.29

## 长盛悦鑫 60 天持有纯债 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	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	4,465,437.28	-256,207.98	4,209,229.30
本期基金份额交易产生的变动数	-2,118,467.41	138,564.74	-1,979,902.67
其中：基金申购款	49,161.37	-408.52	48,752.85
基金赎回款	-2,167,628.78	138,973.26	-2,028,655.52
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,346,969.87	-117,643.24	2,229,326.63

## 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年3月5日（基金合同生效日）至2024年6月30日
活期存款利息收入	29,445.86
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	16,470.55
其他	5.65
合计	45,922.06

## 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
	2024年3月5日（基金合同生效日）至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	5,822,214.99
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	110,021.60
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	5,932,236.59

## 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3月5日（基金合同生效日）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	444,329,546.50
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	436,984,154.51
减：应计利息总额	7,221,290.39
减：交易费用	14,080.00
买卖债券差价收入	110,021.60

#### 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 2024年3月5日（基金合同生效日）至2024年6月30日
1. 交易性金融资产	-295,531.28
股票投资	-
债券投资	-295,531.28
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	-295,531.28

#### 6.4.7.21 其他收入

无。

#### 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 3 月 5 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日
审计费用	23,444.24
信息披露费	-
证券出借违约金	-
账户维护费	9,000.00
开户费	400.00
合计	32,844.24

## 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
中信银行股份有限公司（“中信银行”）	基金托管人

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 3 月 5 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	476,166.60
其中：应支付销售机构的客户维护费	237,696.14
应支付基金管理人的净管理费	238,470.46

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 3 月 5 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	79,361.09

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 0.05% 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

#### 6.4.10.2.3 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		
	2024 年 3 月 5 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长盛悦鑫 60 天持有纯 债 A	长盛悦鑫 60 天持有纯 债 C	合计
长盛基金公司	-	14.24	14.24
中信银行	-	270,922.47	270,922.47
合计	-	270,936.71	270,936.71

注：基金销售服务费每日计提，按月支付。本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的年销售服务费率为 0.20%。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年销售服务费率} / \text{当年天数}$$

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3月5日（基金合同生效日）至2024年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
	中信银行	163,311.26
合计	163,311.26	29,445.86

注：本基金的银行存款由基金托管人中信银行保管，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 57,012,415.06 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
102281400	22 潞安 MTN011	2024 年 7 月 1 日	102.67	100,000	10,266,655.89
102281586	22 晋能煤业 MTN012B(科创票据)	2024 年 7 月 1 日	107.95	100,000	10,794,887.43
102281906	22 晋能装备 MTN008(科创票据)	2024 年 7 月 1 日	106.56	89,000	9,483,860.43
2020002	20 杭州银行永续债	2024 年 7 月 1 日	102.97	100,000	10,296,765.03
2020016	20 江苏银行永续债	2024 年 7 月 1 日	102.25	200,000	20,449,583.56
2028006	20 邮储银行永续债	2024 年 7 月 1 日	102.24	42,000	4,294,046.63
合计				631,000	65,585,798.97

#### 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信银行，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
A-1	-
A-1 以下	-
未评级	30,311,098.75
合计	30,311,098.75

注：未评级部分为企业超短期融资券和政策性金融债。

##### 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
--------	-------------------

AAA	154,144,103.51
AAA 以下	51,564,861.28
未评级	87,239,975.76
合计	292,948,940.55

注：未评级部分为中期票据。

#### 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于持有期届满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 57,012,415.06 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时间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发行的证券不得超过该证券的 10%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流

通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，本基金持有的流动性受限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	163,234.67	-	-	76.59	163,311.26
存出保证金	1,900.42	-	-	0.81	1,901.23
交易性金融资产	212,841,000.00	105,224,400.00	-	5,194,639.30	323,260,039.30

应收申购款	-	-	-	754,962.52	754,962.52
资产总计	213,006,135.09	105,224,400.00	-	5,949,679.22	324,180,214.31
负债					
应付赎回款	-	-	-	10,106.06	10,106.06
应付管理人报酬	-	-	-	71,860.93	71,860.93
应付托管费	-	-	-	11,976.80	11,976.80
卖出回购金融资产款	56,999,571.50	-	-	12,843.56	57,012,415.06
应付销售服务费	-	-	-	40,757.19	40,757.19
应交税费	-	-	-	22,740.73	22,740.73
其他负债	-	-	-	51,408.05	51,408.05
负债总计	56,999,571.50	-	-	221,693.32	57,221,264.82
利率敏感度缺口	156,006,563.59	105,224,400.00	-	5,727,985.90	266,958,949.49

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约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）
	1. 市场利率下降 25 个基点	669,061.86
	2. 市场利率上升 25 个基点	-669,061.86

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

#### 6.4.14 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
第一层次	-
第二层次	323,260,039.30
第三层次	-
合计	323,260,039.30

##### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

本基金本期持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

##### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 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。

##### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	323,260,039.30	99.72
	其中：债券	323,260,039.30	99.72

	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	163,311.26	0.05
8	其他各项资产	756,863.75	0.23
9	合计	324,180,214.31	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	91,705,767.89	34.35
	其中：政策性金融债	20,217,956.28	7.57
4	企业债券	30,889,657.54	11.57
5	企业短期融资券	10,093,142.47	3.78
6	中期票据	190,571,471.40	71.39
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-



10	合计	323,260,039.30	121.09
----	----	----------------	--------

## 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	102281555	22 华阳新材 MTN013	220,000	24,050,916.94	9.01
2	102382625	23 鄂联投 MTN005	200,000	21,124,459.02	7.91
3	102380703	23 天安煤业 MTN001(科创 票据)	200,000	20,876,276.16	7.82
4	102382381	23 水利三 MTN001	200,000	20,832,194.54	7.80
5	102102329	21 中建四局 MTN002	200,000	20,664,802.19	7.74

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未投资国债期货。

### 7.10.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

## 7.11 投资组合报告附注

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

#### （一）20 江苏银行永续债

2023 年 8 月 18 日，苏金罚决字（2023）2 号显示，江苏银行股份有限公司存在报送的互联网保险业务数据不真实，未按规定披露互联网保险信息等违法违规事实，被处警告，罚款 16 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。

## （二）20 中国银行永续债 01

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。

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

### 7.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金本报告期末未持有股票。

### 7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,901.23
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	754,962.52
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	756,863.75

### 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	户均持有的基	持有人结构
------	-----	--------	-------

	户数 (户)	金份额	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 (%)
长盛悦鑫 60 天持有 纯债 A	214	196,563.30	0.00	0.00	42,064,545.97	100.00
长盛悦鑫 60 天持有 纯债 C	1,150	193,231.51	0.00	0.00	222,216,235.60	100.00
合计	1,364	193,754.24	0.00	0.00	264,280,781.57	100.00

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	长盛悦鑫 60 天持有纯债 A	1.00	0.0000
	长盛悦鑫 60 天持有纯债 C	0.00	0.0000
	合计	1.00	0.0000

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、 基金投资和研部门 负责人持有本开放式 基金	长盛悦鑫 60 天持有纯债 A	0
	长盛悦鑫 60 天持有纯债 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有 本开放式基金	长盛悦鑫 60 天持有纯债 A	0
	长盛悦鑫 60 天持有纯债 C	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	长盛悦鑫 60 天持有纯债 A	长盛悦鑫 60 天持有纯债 C
基金合同生效日 (2024 年 3 月 5 日) 基金份额总额	80,351,631.23	554,111,898.10
基金合同生效日起至 报告期期末基金总申 购份额	1,571,535.47	7,359,041.74
减:基金合同生效日 起至报告期期末基金 总赎回份额	39,858,620.73	339,254,704.24
基金合同生效日起至 报告期期末基金拆分 变动份额	-	-
本报告期末基金份 额总额	42,064,545.97	222,216,235.60

## § 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

本报告期内本基金管理人的高级管理人员未发生重大人事变动。

#### 10.2.2 基金经理的变动情况

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

本报告期内,无涉及本基金管理人、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，托管人及其高级管理人员未受到稽查或处罚等情况。

## 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 (%)	
东吴证券	2	-	-	-	-	-

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
东吴证券	30,361,800.00	100.00	2,300,000.00	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、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	长盛悦鑫 60 天持有期纯债债券型证券投资基金基金合同	中国证监会指定披露媒介	2024 年 2 月 8 日
2	长盛悦鑫 60 天持有期纯债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	2024 年 2 月 8 日
3	长盛悦鑫 60 天持有期纯债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	2024 年 2 月 8 日
4	长盛悦鑫 60 天持有期纯债债券型证券投资基金（长盛悦鑫 60 天持有纯债 A 份额）基金产品资料概要	中国证监会指定披露媒介	2024 年 2 月 8 日
5	长盛悦鑫 60 天持有期纯债债券型证券投资基金（长盛悦鑫 60 天持有纯债 C 份额）基金产品资料概要	中国证监会指定披露媒介	2024 年 2 月 8 日
6	长盛悦鑫 60 天持有期纯债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	2024 年 2 月 8 日
7	长盛悦鑫 60 天持有期纯债债券型证券投资基金托管协议	中国证监会指定披露媒介	2024 年 2 月 8 日
8	长盛基金管理有限公司关于增加长盛悦鑫 60 天持有期纯债债券型证券投资基金代销机构的公告	中国证监会指定披露媒介	2024 年 2 月 28 日
9	长盛悦鑫 60 天持有期纯债债券型证券投资基金提前结束募集期的公告	中国证监会指定披露媒介	2024 年 2 月 29 日
10	长盛悦鑫 60 天持有期纯债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	2024 年 3 月 6 日
11	长盛悦鑫 60 天持有期纯债债券型证券投资基金基金开放日常申购（赎回、转换、定期定额投资）业务公告	中国证监会指定披露媒介	2024 年 4 月 1 日
12	长盛基金管理有限公司关于旗下基金增加腾安基金为销售机构的公告	中国证监会指定披露媒介	2024 年 6 月 4 日
13	长盛悦鑫 60 天持有期纯债债券型证券投资基金（长盛悦鑫 60 天持有纯债 A 份额）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 28 日
14	长盛悦鑫 60 天持有期纯债债券型证券投资基金（长盛悦鑫 60 天持有纯债 C 份额）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 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

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期内无影响投资者决策的其他重要信息。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、长盛悦鑫 60 天持有期纯债债券型证券投资基金相关批准文件；
- 2、《长盛悦鑫 60 天持有期纯债债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长盛悦鑫 60 天持有期纯债债券型证券投资基金托管协议》；
- 4、《长盛悦鑫 60 天持有期纯债债券型证券投资基金招募说明书》；
- 5、法律意见书；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照。

### 12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的办公地址。

### 12.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人长盛基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-888-2666、010-86497888。

网址：<http://www.csfunds.com.cn>。

长盛基金管理有限公司

2024 年 8 月 30 日