

长盛盛康纯债债券型证券投资基金 2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：长盛基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

送出日期：2024 年 3 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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 03 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。

报告期内，经与基金托管人协商一致，本基金自 2023 年 11 月 6 日起增加 E 类基金份额，E 类基金代码：019899。详情参阅本基金管理人于 2023 年 11 月 6 日披露的《关于长盛盛康纯债债券型证券投资基金增加 E 类基金份额并修改基金合同等法律文件的公告》。

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。

本年度报告财务资料已经审计，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 2023 年 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况 | 6 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标 | 6 |
| 3.2 基金净值表现 | 10 |
| 3.3 过去三年基金的利润分配情况 | 15 |
| § 4 管理人报告 | 15 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况 | 15 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 | 17 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 | 17 |
| 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 | 18 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 | 19 |
| 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 | 20 |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 | 21 |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 | 21 |
| 4.9 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 | 21 |
| § 5 托管人报告 | 21 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 | 21 |
| 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 | 21 |
| 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 | 22 |
| § 6 审计报告 | 22 |
| 6.1 审计报告基本信息 | 22 |
| 6.2 审计报告的基本内容 | 22 |
| § 7 年度财务报表 | 24 |
| 7.1 资产负债表 | 24 |
| 7.2 利润表 | 25 |
| 7.3 净资产变动表 | 26 |
| 7.4 报表附注 | 28 |
| § 8 投资组合报告 | 53 |

| | |
|---|-----------|
| 8.1 期末基金资产组合情况 | 53 |
| 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 | 53 |
| 8.3 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 | 54 |
| 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 | 54 |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 54 |
| 8.6 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 | 54 |
| 8.7 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 | 55 |
| 8.8 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 | 55 |
| 8.9 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 | 55 |
| 8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 55 |
| 8.11 投资组合报告附注 | 55 |
| § 9 基金份额持有人信息 | 56 |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 56 |
| 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 56 |
| 9.3 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 | 57 |
| § 10 开放式基金份额变动 | 57 |
| § 11 重大事件揭示 | 58 |
| 11.1 基金份额持有人大会决议 | 58 |
| 11.2 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 | 58 |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 58 |
| 11.4 基金投资策略的改变 | 58 |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 58 |
| 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 | 59 |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 59 |
| 11.8 其他重大事件 | 60 |
| § 12 影响投资者决策的其他重要信息 | 63 |
| 12.1 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 | 63 |
| 12.2 影响投资者决策的其他重要信息 | 63 |
| § 13 备查文件目录 | 63 |
| 13.1 备查文件目录 | 63 |
| 13.2 存放地点 | 63 |
| 13.3 查阅方式 | 64 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | | | |
|-----------------|-----------------|----------------|---------------|-------------|
| 基金名称 | 长盛盛康纯债债券型证券投资基金 | | | |
| 基金简称 | 长盛盛康纯债 | | | |
| 基金主代码 | 003922 | | | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | | | |
| 基金合同生效日 | 2018年12月20日 | | | |
| 基金管理人 | 长盛基金管理有限公司 | | | |
| 基金托管人 | 交通银行股份有限公司 | | | |
| 报告期末基金份额总额 | 166,301,247.29份 | | | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | | | |
| 下属分级基金的基金简称 | 长盛盛康纯债 A | 长盛盛康纯债 C | 长盛盛康纯债 D | 长盛盛康纯债 E |
| 下属分级基金的交易代码 | 003922 | 003923 | 013468 | 019899 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 81,271,570.52份 | 79,170,649.13份 | 5,100,326.57份 | 758,701.07份 |

注：报告期内，本基金自 2023 年 11 月 6 日起增加 E 类基金份额，详情参阅《关于长盛盛康纯债债券型证券投资基金增加 E 类基金份额并修改基金合同等法律文件的公告》。

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|---|
| 投资目标 | 在控制风险和保持资产流动性的基础上，追求基金资产的长期稳健增值，并力争获得超过业绩比较基准的投资业绩。 |
| 投资策略 | <p>（一）大类资产配置策略</p> <p>本基金将在综合判断宏观经济周期、市场资金供需状况、大类资产估值水平对比的基础上，结合政策分析，确定不同投资期限内的大类金融资产配置和债券类属配置。同时通过严格风险评估，及时调整资产组合比例，保持资产配置风险、收益平衡，以稳健提升投资组合回报。</p> <p>（二）债券组合管理策略</p> <p>本基金债券组合管理策略包含：利率策略、类属配置策略、信用策略、相对价值策略、债券选择策略。</p> |
| 业绩比较基准 | 中债综合指数(全价)收益率 |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，属证券投资基金中的较低风险品种，其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金。 |

2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | 基金管理人 | 基金托管人 |
|---------|------------|--------------|
| 名称 | 长盛基金管理有限公司 | 交通银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 张利宁 |
| | 联系电话 | 010-86497608 |
| | | 陆志俊 |
| | | 95559 |

| | | |
|--------|-----------------------------------|-------------------------|
| 电子邮箱 | zhangln@csfunds.com.cn | luzj@bankcomm.com |
| 客户服务电话 | 400-888-2666、010-86497888 | 95559 |
| 传真 | 010-86497999 | 021-62701216 |
| 注册地址 | 深圳市福田区福中三路诺德金融中心主楼 10D | 中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号 |
| 办公地址 | 北京市朝阳区安定路 5 号院 3 号楼中建财富国际中心 3-5 层 | 中国（上海）长宁区仙霞路 18 号 |
| 邮政编码 | 100029 | 200336 |
| 法定代表人 | 胡甲 | 任德奇 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---------------------|---|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 《证券时报》 |
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | http://www.csfunds.com.cn |
| 基金年度报告备置地点 | 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 |
|--------|----------------------|-----------------------------------|
| 会计师事务所 | 普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙） | 中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼 |
| 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、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 2023 年 | | | | 2022 年 | | | 2021 年 | | 2021 年 9 月 2 日（基金合同生效日）- 2021 年 12 月 31 日 |
|---------------|--------|--------|--------|--|--------|--------|--------|--------|------|---|
| | 长盛盛康纯债 | 长盛盛康纯债 | 长盛盛康纯债 | 长盛盛康 | 长盛盛康纯债 | 长盛盛康纯债 | 长盛盛康纯债 | 长盛盛康纯债 | 长盛盛康 | |
| | | | | 2023 年 11 月 6 日（基金合同生效日）- 2023 年 12 月 31 日 | | | | | | |

| | A | C | D | 纯债 E | A | C | D | A | 纯债 C | 纯债 D |
|--------------|---------------|--------------|------------|----------|---------------|---------------|------------|--------------|-----------|---------|
| 本期已实现收益 | 18,471,512.31 | 5,596,874.63 | 292,526.98 | 1,567.46 | 20,497,907.17 | 561,818.09 | 345,115.53 | 4,465,509.20 | 71,703.12 | - |
| 本期利润 | 28,784,490.81 | 3,871,924.41 | 229,536.33 | 2,977.40 | 12,394,712.52 | -1,203,899.12 | 231,093.79 | 6,427,600.59 | 70,241.57 | - |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0739 | 0.0417 | 0.0493 | 0.0112 | 0.0214 | -0.0705 | 0.0147 | 0.0421 | 0.0125 | - |
| 本期加权平均净值利润率 | 6.61% | 3.71% | 4.34% | 0.98% | 1.94% | -6.40% | 1.36% | 3.98% | 1.20% | - |
| 本期基金份额净值 | 5.27% | 5.16% | 5.28% | 0.85% | 2.11% | 1.99% | 2.11% | 1.82% | 1.63% | 1.49% |

| 增长率 | | | | | | | | | | | |
|--------------|---------------|---------------|--------------|------------|----------------|---------------|--------------|----------------|------------|--------|--|
| 3.1.2 | 2023 年末 | | | | 2022 年末 | | | 2021 年末 | | | |
| 期末可供分配利润 | 6,784,808.05 | 5,101,392.55 | 426,311.63 | 63,617.73 | 28,004,972.15 | 353,210.37 | 70,186.97 | 1,893,565.76 | -6,586.49 | - | |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0835 | 0.0644 | 0.0836 | 0.0839 | 0.0424 | 0.0249 | 0.0423 | 0.0066 | -0.0092 | - | |
| 期末基金资产净值 | 93,676,561.77 | 90,155,296.79 | 5,879,036.26 | 874,813.94 | 723,562,581.03 | 15,366,327.64 | 1,814,748.17 | 306,704,338.57 | 758,073.40 | - | |
| 期末基金 | 1.1526 | 1.1387 | 1.1527 | 1.1530 | 1.0949 | 1.0828 | 1.0949 | 1.0723 | 1.0617 | 1.0723 | |

| | | | | | | | | | | |
|---|---------|--------|-------|-------|---------|-------|-------|---------|-------|-------|
| 份 额 净 值 | | | | | | | | | | |
| 3. 1. 3 累 计 期 末 指 标 | 2023 年末 | | | | 2022 年末 | | | 2021 年末 | | |
| 基 金 份 额 累 计 净 值 增 长 率 | 15.18% | 13.79% | 9.10% | 0.85% | 9.41% | 8.21% | 3.62% | 7.15% | 6.10% | 1.49% |

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 12 月 31 日。

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

5、本基金自 2021 年 9 月 2 日起增加 D 类基金份额，并自该日起接受投资者对 D 类基金份额的申购和赎回。

6、本基金自 2023 年 11 月 6 日起增加 E 类基金份额，并自该日起接受投资者对 E 类基金份额的申购和赎回。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

长盛盛康纯债 A

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|----------|----------|-------------|------------|---------------|-------|--------|
| 过去三个月 | 0.99% | 0.03% | 0.82% | 0.04% | 0.17% | -0.01% |
| 过去六个月 | 1.62% | 0.04% | 0.83% | 0.04% | 0.79% | 0.00% |
| 过去一年 | 5.27% | 0.04% | 2.06% | 0.04% | 3.21% | 0.00% |
| 过去三年 | 9.45% | 0.06% | 4.74% | 0.05% | 4.71% | 0.01% |
| 过去五年 | 14.98% | 0.09% | 6.04% | 0.06% | 8.94% | 0.03% |
| 自基金转型起至今 | 15.18% | 0.09% | 6.49% | 0.06% | 8.69% | 0.03% |

长盛盛康纯债 C

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|----------|----------|-------------|------------|---------------|-------|--------|
| 过去三个月 | 0.97% | 0.03% | 0.82% | 0.04% | 0.15% | -0.01% |
| 过去六个月 | 1.59% | 0.04% | 0.83% | 0.04% | 0.76% | 0.00% |
| 过去一年 | 5.16% | 0.04% | 2.06% | 0.04% | 3.10% | 0.00% |
| 过去三年 | 9.00% | 0.06% | 4.74% | 0.05% | 4.26% | 0.01% |
| 过去五年 | 13.61% | 0.29% | 6.04% | 0.06% | 7.57% | 0.23% |
| 自基金转型起至今 | 13.79% | 0.29% | 6.49% | 0.06% | 7.30% | 0.23% |

长盛盛康纯债 D

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|-------|----------|-------------|------------|---------------|-------|--------|
| 过去三个月 | 1.00% | 0.03% | 0.82% | 0.04% | 0.18% | -0.01% |
| 过去六个月 | 1.65% | 0.04% | 0.83% | 0.04% | 0.82% | 0.00% |
| 过去一年 | 5.28% | 0.04% | 2.06% | 0.04% | 3.22% | 0.00% |

| | | | | | | |
|------------------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|
| 自基金新增本类 份额起至今 | 9.10% | 0.06% | 2.97% | 0.05% | 6.13% | 0.01% |
|------------------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|

长盛盛康纯债 E

| 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 |
|------------------|--------------|---------------------|--------------------|-----------------------|--------|--------|
| 自基金新增本类 份额起至今 | 0.85% | 0.01% | 0.96% | 0.04% | -0.11% | -0.03% |

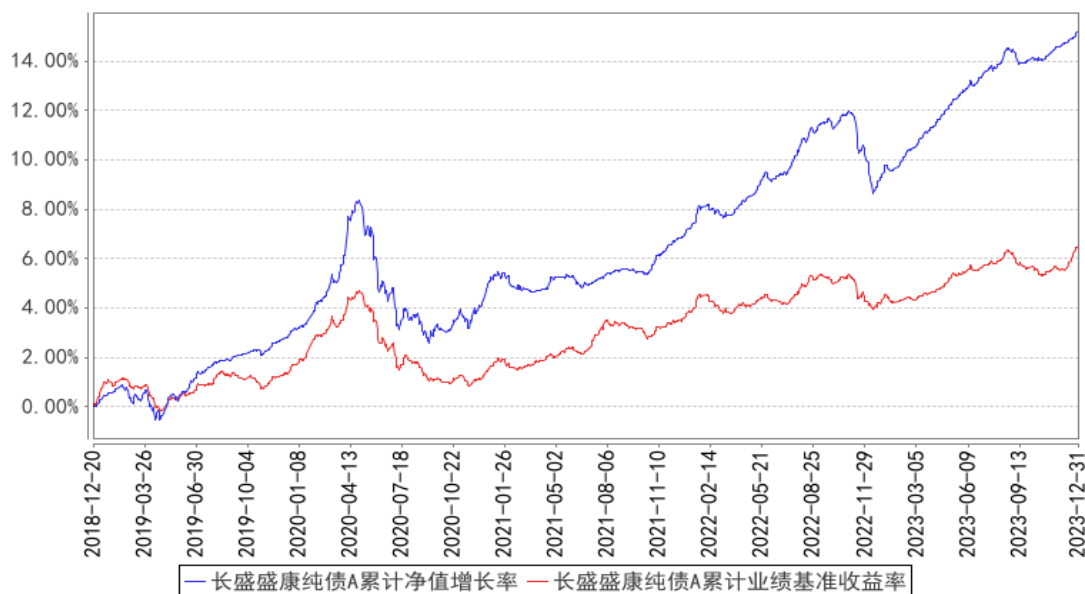
注：本基金业绩比较基准：中债综合指数（全价）收益率

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

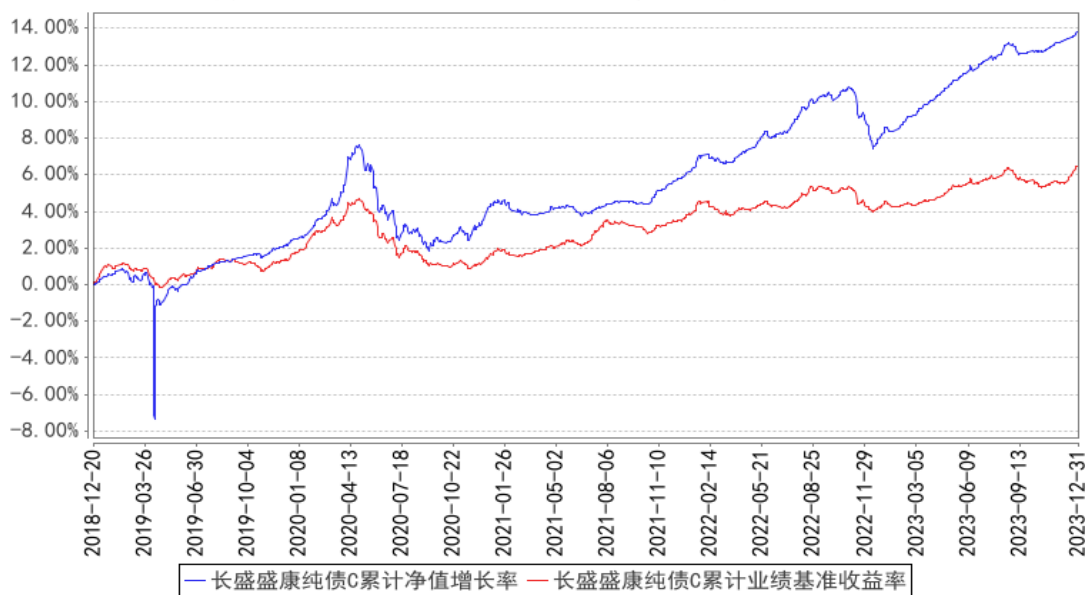
本基金为债券型基金，投资范围为固定收益类金融工具，且本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产，也不参与一级市场新股申购和新股增发，可转换债券仅投资可分离交易可转债的纯债部分。鉴于中债综合指数（全价）能够反映债券全市场的整体价格和投资回报情况，所以以其收益率作为本基金的业绩比较基准。

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

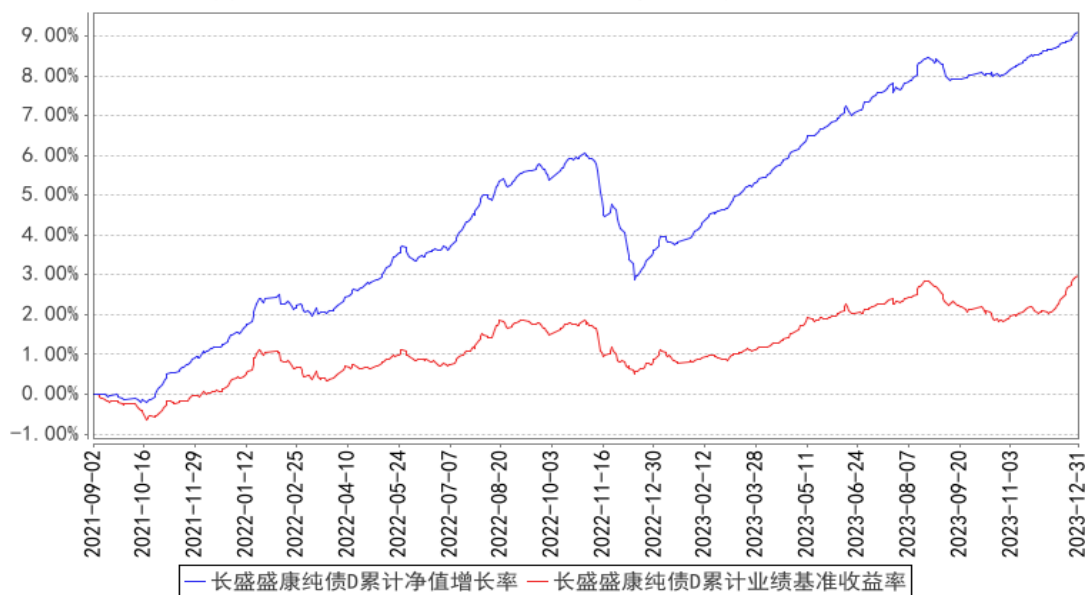
长盛盛康纯债A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



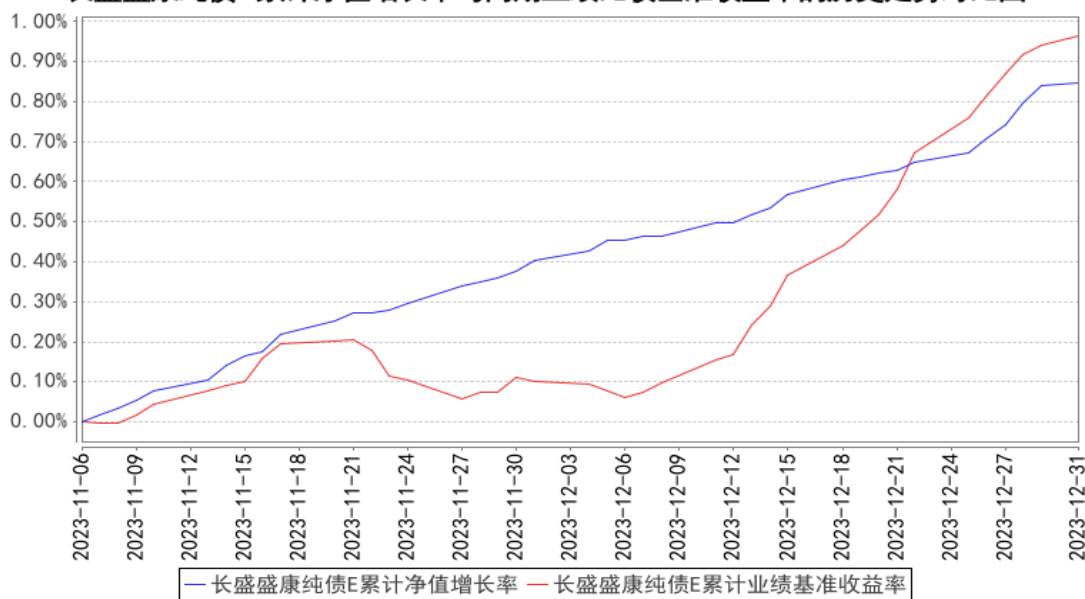
长盛盛康纯债C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



长盛盛康纯债D累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



长盛盛康纯债E累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

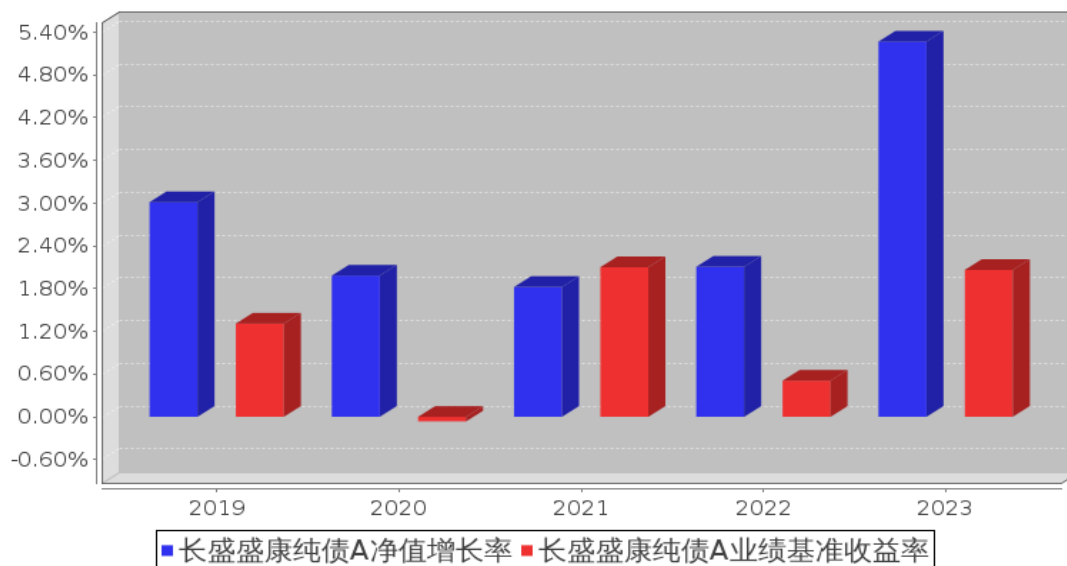


注：1、长盛盛康纯债债券型证券投资基金由长盛盛康灵活配置混合型证券投资基金转型而来，转型日期为 2018 年 12 月 20 日（即基金合同生效日）。

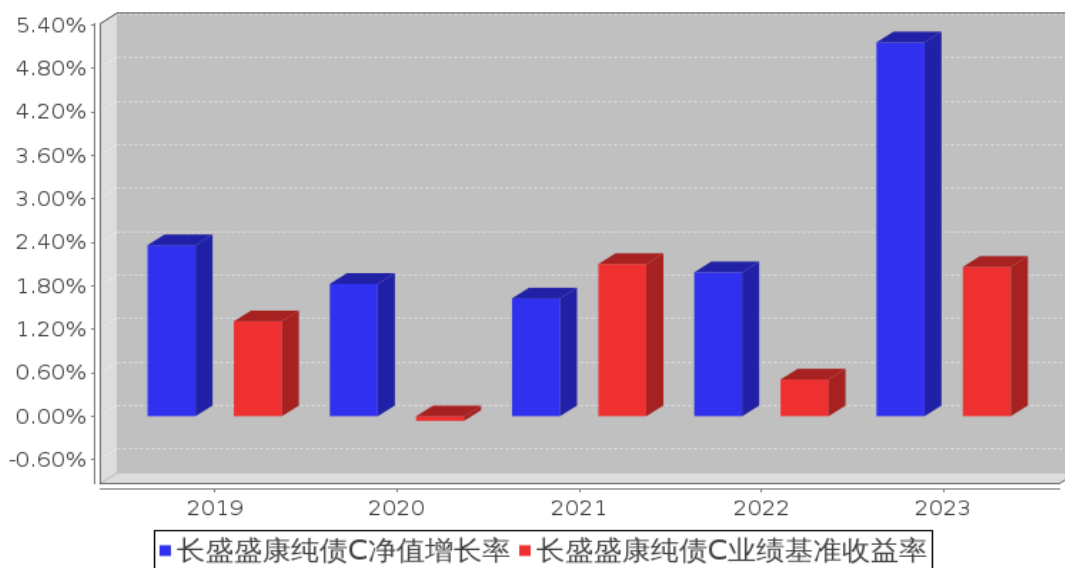
2、按照本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。截至报告日，本基金的各项资产配置比例符合基金合同的有关约定。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

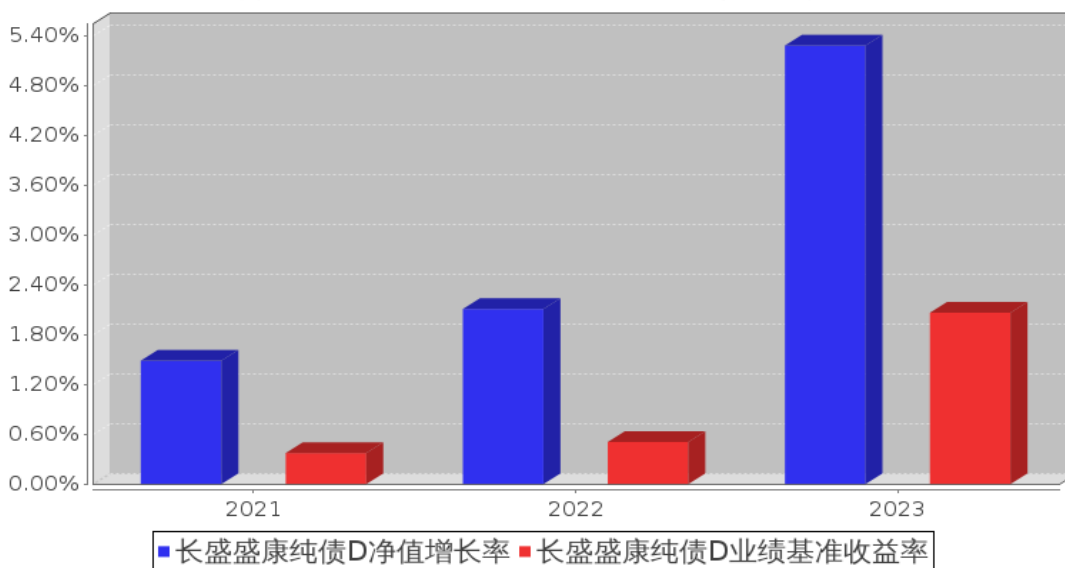
长盛盛康纯债A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



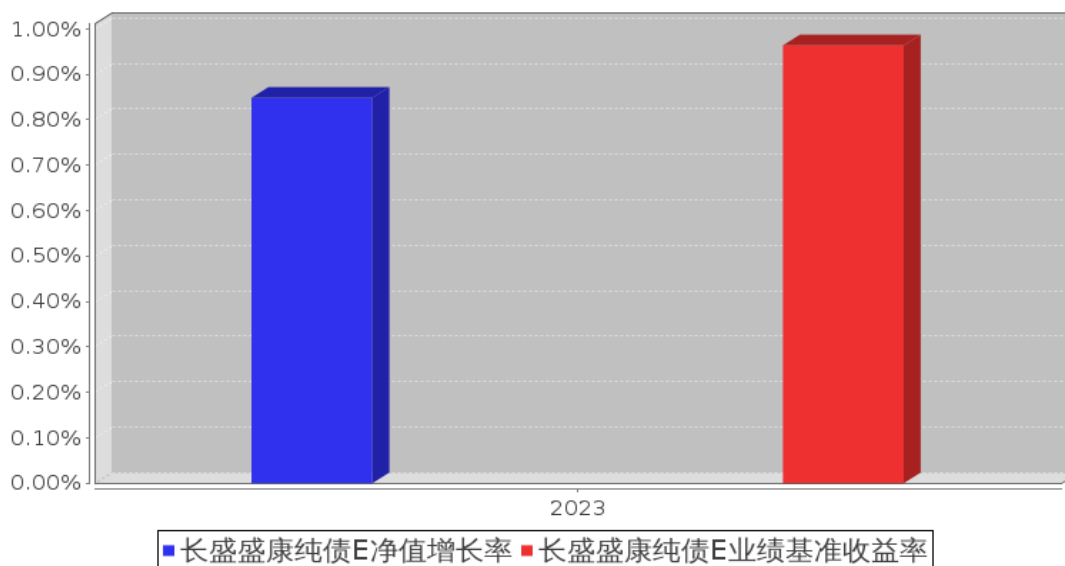
长盛盛康纯债C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



长盛盛康纯债D基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



长盛盛康纯债E基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：长盛盛康纯债债券型证券投资基金由长盛盛康灵活配置混合型证券投资基金转型而来，转型日期为 2018 年 12 月 20 日（即基金合同生效日），基金合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。本基金 D 类基金份额自 2021 年 9 月 2 日起接受投资者的申购和赎回，当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。本基金 E 类基金份额自 2023 年 11 月 6 日起接受投资者的申购和赎回，当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金于过去三年未进行利润分配。

§ 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，是国内较早成立的十家基金管理公司之一，公司注册资本为人民币 2.06 亿元。长盛基金总部设在北京，在北京、上海、成都、深圳等地设有分支机构，下设长盛基金（香港）有限公司和长盛创富资产管理有限公司两家全资子公司。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、社保基金、特定客户资产管理、合格境内机构投资者（QDII）、合格境外机构投资者（QFII）、保险资产管理人等业务资格，同时可担任私募资产管理计划和境外 QFII 基金的投资顾问。截至 2023 年 12 月 31 日，基金管理人共管理七十只开放式基金，并管理多个全国社保基金组

合和私募资产管理计划。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理（助理）期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|----|--|-----------------|------------|--------|--|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 李琪 | 本基金基金经理。 | 2019年11月25日 | 2023年9月22日 | 18年 | 李琪先生，博士。历任大公国际资信评估有限公司信用分析师、信用评审委员会委员，泰康资产管理有限责任公司信用研究员。2011年3月加入长盛基金管理有限公司，曾任信用研究员、基金经理助理等职务。 |
| 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，长盛盛启债券型证券投资基金基金经理。 | 2023年9月19日 | - | 10年 | 张建先生，硕士。曾任中国银河证券股份有限公司交易员/投资助理、银河金汇证券资产管理有限公司投资助理/投资主办人。2021年11月加入长盛基金管理有限公司固定收益部。 |

注：1、上表基金经理的任职日期和离任日期均指公司决定确定的聘任日期和解聘日期；

2、“证券从业年限”中“证券从业”的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本基金本报告期内无基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.1.4 基金经理薪酬机制

本基金基金经理薪酬激励不存在与私募资产管理计划浮动管理费或产品业绩表现挂钩的情

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、本基金的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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《公司公平交易细则》，从投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等环节严格把关，通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易公平执行，确保公平对待不同投资组合，包括公募基金、社保组合、私募资产管理计划等，切实防范利益输送，保护投资者的合法权益。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。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度等规定，通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易公平执行，确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送，保护投资者的合法权益。

公司对管理的不同投资组合过去 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原则及利益输送的行为。

4.3.3 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，本基金未发生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

2023 年，债券市场表现较好，呈现牛市行情。整体看，信用债表现优于利率债，中低等级信用债表现更佳。年初，“强预期、弱现实”的主线逻辑主导债市行情，理财和基金对信用债的配置需求助力信用债逆势走强，利率债和信用债走势分化。一季度，经济增长预期较强，加上资金面趋紧，利率债短端收益率上行，中长端受益于城商农商等机构的配置需求，呈现震荡行情；信用债经过 2022 年底的调整后，具有明显的投资价值，随着银行理财、基金等产品负债端的恢复，信用债配置需求旺盛，收益率呈下行趋势。进入四月份，经济数据走弱，货币环境改善，加上权益市场疲软，债市进一步走强，信用债和利率债均呈现牛市行情。九月份开始，稳增长预期增强，政策频出，刺激市场神经。随着“防空转”和“稳汇率”的重要性提升，资金面趋紧，叠加 1 万亿新增国债和 1.4 万亿特殊再融资债的供给冲击，资金价格中枢明显抬升，对债市形成冲击，债市调整明显。城投债受益于隐债化解，逆势走强，尤其在特殊再融资债陆续发行后，收益率快速下行，信用利差明显压缩，具有绝对收益优势的中低等级城投债表现尤其突出，期限利差及信用利差压缩至历史低位。随着城投债利差压缩，以钢铁、煤炭为代表的产业债投资性价比显著提高，收益率逐渐步入快速下行通道。全年看，债市呈现牛市行情。

2023 年，央行综合运用总量和结构性货币政策工具，足量投放资金，多次通过降准及 MLF 超量续作投放长期资金，并通过 OMO 操作，在税期、月末、季末等关键时点加大资金投放，平抑资金面波动。与此同时，通过调降 MLF 利率和 LPR 利率，引导市场利率下行，降低企业融资成本。整体看，货币环境较为宽松。

在此背景下，债券收益率整体下行。以国开债为例，10 年下行 31.11BP 至 2.6796%，5 年下行 34.56BP 至 2.4856%，1 年下行 3.24BP 至 2.1993%，债券市场呈现牛平趋势。

2、报告期内本基金投资策略分析

报告期内，本基金主要投资于流动性较好的中短期债券，并积极参与波段交易的机会，在防范信用风险的前提下，根据市场情况不断调整资产结构。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末长盛盛康纯债 A 的基金份额净值为 1.1526 元，本报告期基金份额净值增长率为 5.27%，同期业绩比较基准收益率为 2.06%；截至本报告期末长盛盛康纯债 C 的基金份额净值为 1.1387 元，本报告期基金份额净值增长率为 5.16%，同期业绩比较基准收益率为 2.06%；截至本报告期末长盛盛康纯债 D 的基金份额净值为 1.1527 元，本报告期基金份额净值增长率为 5.28%，同期业绩比较基准收益率为 2.06%；截至本报告期末长盛盛康纯债 E 的基金份额净值为 1.1530 元，本报告期（2023 年 11 月 6 日至 12 月 31 日）基金份额净值增长率为 0.85%，同期业绩比较基准收益率为 0.96%。

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 2024 年，在新旧动能转换、高质量发展的背景下，经济增长压力较大。房地产及其上下游产业链依旧处于出清阶段，对经济增长形成拖累，而新动能的增长不足以弥补房地产等对经济增长形成的拖累。2024 年，预计出口有所改善，对经济形成支撑，制造业依旧维持较快增长，但进一步发力空间有限，基建继续发力，财政投放将适度加力，对经济增长形成支撑。消费增速维持高位，消费结构进一步改善。综合看，房地产对经济增长形成拖累，出口和基建有望进一步增长发力，“三大工程”项目将陆续落地，对经济增长形成托底效应。全年看，经济增长面临一定的压力，诉诸政策支持的可能性较大。

货币政策方面，货币环境有望维持相对宽松，在隐债化债和经济增长压力较大的背景下，稳健偏宽松的货币政策取向或是更优的选择。预计央行将兼顾总量和结构性货币政策工具，结合市场情况，灵活投放资金，满足市场主体对资金的需求，同时对“防空转”和“提升信贷效能”也有一定诉求。预计降准、降息均有望陆续落地，整体看，货币环境较为友好。

市场层面，各类债券收益率处于历史低位，债券的信用利差和期限利差快速收缩，在隐债化债的大背景下，资产荒逻辑或贯穿全年，具有绝对收益优势的信用债成为稀缺资产，严控兑付风险下的信用挖掘策略或成为市场共识。利率债在机构配置行情下，长端及超长端收益率快速下行，屡创新低。整体看，利率债在强势行情中或有一定的波动，整体风险不大。

预计 2024 年，债券资产收益率大幅上行风险不大。经济增长面临较大压力、货币环境较为友好、债券资产荒行情延续，对债市形成利多。与此同时，债券收益率处于低位，债市有一定的调整压力。综上，预计债市全年以小幅震荡行情为主，风险不大。

在此背景下，结合本基金定位，2024 年，我们将以票息收益为主，追求收益的确定性，并合理使用杠杆，积极把握确定性较大的波段机会，增厚组合收益。在保障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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人遵循合规运作、保护基金投资者利益的原则，结合监管要求、市场形势及自身业务发展需要，由独立于业务部门的监察稽核部对公司经营、受托资产的运作及员工行为的合规性进行监督、检查，发现问题及时督促相关部门改进，并定期制作检查报告报送公司管理层。具体工作情况如下：

1、加强合规宣导与培训，持续推动公司合规文化建设。报告期内，监察稽核部通过外请专业机构、内部自学、岗前培训、基金经理合规谈话、合规考试等多种形式，有重点、有针对性地开展合规培训工作，及时组织学习法律法规与监管文件，深化员工合规理念，提升员工合规工作技能。

2、持续完善公司制度规章体系建设。根据新法规、新监管要求，以及公司业务发展实际，及时督促、提示业务部门进行相关制度、流程的新订、修订与完善，保证公司制度规章的合法合规、全面、适时、有效。报告期内，公司除完成有关制度的新订、修订工作外，还要求业务部门就制度、流程变化内容与其他相关执行部门进行沟通，确保各相关部门对新订、修订内容的理解保持一致，保证制度、流程被严格执行。

3、加强合规监督，确保受托资产投资运作合法合规。紧密跟踪与投资运作相关的法律、法规、受托资产合同及公司制度等的规定，全面把控受托资产投资运作风险点，并以前述风险点为依据，检查、监督各受托资产投资运作合规情况。根据《公司公平交易细则》的规定，通过量化分析、日常合规监督及事后专项检查评估等，确保公司旗下各受托资产被公平对待，防范非公平交易和利益输送。

4、加强专项稽核与检查力度，完善发现问题与改进情况的跟踪、落实机制，保障公司运营及受托资产投资运作合规。报告期内，公司监察稽核部开展定期、临时专项稽核，内容涵盖受托资产投资、研究、交易、销售、员工行为、信息技术等。此外，根据业务发展需要、监管机构通报的业内问题，以及公司在日常监督中发现的问题，临时增加多个检查项目。稽核、检查工作中，监察稽核部重视对发现问题改进完成情况的跟踪，强调问题改进效率与效果，合理保障公司及受托资产合规、稳健运作。

5、参与新产品设计、新业务、新流程的合规论证工作，提供合规意见或建议，确保依法合规开展相关业务。

本基金管理人承诺：在今后的工作中，我们将继续以保护基金投资者的利益为宗旨，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，保障公司、受托资产合规运作。

4.7 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。

4.8 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。

4.9 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

本期间，基金托管人在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

本期间，长盛基金管理有限公司在本基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配，符合基金合同的规定。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本期间，由长盛基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关本基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

| | |
|------------|-------------------------|
| 财务报表是否经过审计 | 是 |
| 审计意见类型 | 标准无保留意见 |
| 审计报告编号 | 普华永道中天审字(2024)第 23861 号 |

6.2 审计报告的基本内容

| | |
|-----------|--|
| 审计报告标题 | 审计报告 |
| 审计报告收件人 | 长盛盛康纯债债券型证券投资基金全体基金份额持有人 |
| 审计意见 | <p>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了长盛盛康纯债债券型证券投资基金(以下简称“长盛盛康纯债债券基金”)的财务报表,包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表,2023 年度的利润表和净资产变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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,公允反映了长盛盛康纯债债券基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。</p> |
| 形成审计意见的基础 | <p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于长盛盛康纯债债券基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p> |
| 其他信息 | <p>长盛盛康纯债债券基金的基金管理人长盛基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括长盛盛康纯债债券基金 2023 年度年度报告中涵盖的信息,但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息,我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计,我们的责任是阅读其他信息,在此过程中,考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已经执行的工作,如果我们确定其他信息存在重大</p> |

| | |
|------------------------|--|
| | <p>错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p> |
| <p>管理层和治理层对财务报表的责任</p> | <p>长盛盛康纯债债券基金的基金管理人长盛基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估长盛盛康纯债债券基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算长盛盛康纯债债券基金、终止运营或别无其他现实的选择。基金管理人治理层负责监督长盛盛康纯债债券基金的财务报告过程。</p> |
| <p>注册会计师对财务报表审计的责任</p> | <p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二)了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三)评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四)对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对长盛盛康纯债债券基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致长盛盛康纯债债券基金不能持续经营。</p> <p>(五)评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重</p> |

| | | |
|-----------|---|-----|
| | 大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。 | |
| 会计师事务所的名称 | 普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙) | |
| 注册会计师的姓名 | 张勇 | 段黄霖 |
| 会计师事务所的地址 | 中国·上海市 | |
| 审计报告日期 | 2024 年 3 月 27 日 | |

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：长盛盛康纯债债券型证券投资基金

报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2023 年 12 月 31 日 | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------|---------------------------------|----------------------------------|
| 资产： | | | |
| 货币资金 | 7.4.7.1 | 2,768,634.48 | 701,626.36 |
| 结算备付金 | | 39,817.76 | 5,241,574.95 |
| 存出保证金 | | 30,284.60 | 4,896.71 |
| 交易性金融资产 | 7.4.7.2 | 188,802,130.28 | 984,702,886.35 |
| 其中：股票投资 | | - | - |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 188,802,130.28 | 971,556,169.70 |
| 资产支持证券投资 | | - | 13,146,716.65 |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 其他投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 7.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 7.4.7.4 | - | - |
| 债权投资 | 7.4.7.5 | - | - |
| 其中：债券投资 | | - | - |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 其他投资 | | - | - |
| 其他债权投资 | 7.4.7.6 | - | - |
| 其他权益工具投资 | 7.4.7.7 | - | - |
| 应收清算款 | | - | 603,065.16 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 1,036,695.57 | 754,266.28 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 7.4.7.8 | - | - |
| 资产总计 | | 192,677,562.69 | 992,008,315.81 |
| 负债和净资产 | 附注号 | 本期末 2023 年 12 月 31 日 | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 |
| 负债： | | | |

| | | | |
|-------------|----------|----------------|----------------|
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 7.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | 249,599,467.73 |
| 应付清算款 | | - | 978,198.68 |
| 应付赎回款 | | 1,821,100.73 | 185,830.39 |
| 应付管理人报酬 | | 39,134.45 | 189,134.51 |
| 应付托管费 | | 10,435.85 | 50,435.89 |
| 应付销售服务费 | | 6,870.26 | 1,403.87 |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | 11,969.03 | 53,631.32 |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 7.4.7.9 | 202,343.61 | 206,556.58 |
| 负债合计 | | 2,091,853.93 | 251,264,658.97 |
| 净资产： | | | |
| 实收基金 | 7.4.7.10 | 166,301,247.29 | 676,677,834.06 |
| 其他综合收益 | 7.4.7.11 | - | - |
| 未分配利润 | 7.4.7.12 | 24,284,461.47 | 64,065,822.78 |
| 净资产合计 | | 190,585,708.76 | 740,743,656.84 |
| 负债和净资产总计 | | 192,677,562.69 | 992,008,315.81 |

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，长盛盛康纯债 A 的基金份额净值为 1.1526 元，份额总额为 81,271,570.52 份；长盛盛康纯债 C 的基金份额净值为 1.1387 元，份额总额为 79,170,649.13 份；长盛盛康纯债 D 的基金份额净值为 1.1527 元，份额总额为 5,100,326.57 份；长盛盛康纯债 E 的基金份额净值为 1.1530 元，份额总额为 758,701.07 份。基金份额总额 166,301,247.29 份。

7.2 利润表

会计主体：长盛盛康纯债债券型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 |
|----------------|----------|---|--|
| 一、营业总收入 | | 38,264,395.63 | 18,260,297.90 |
| 1. 利息收入 | | 180,213.17 | 397,481.31 |
| 其中：存款利息收入 | 7.4.7.13 | 118,165.74 | 125,115.05 |
| 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 | | 62,047.43 | 272,366.26 |

| | | | |
|----------------------------|------------|----------------------|----------------------|
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | | 29,523,445.46 | 27,827,106.54 |
| 其中：股票投资收益 | 7.4.7.14 | - | - |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 7.4.7.15 | 29,259,036.22 | 27,284,867.32 |
| 资产支持证券投资 收益 | 7.4.7.16 | 264,409.24 | 542,239.22 |
| 贵金属投资收益 | 7.4.7.17 | - | - |
| 衍生工具收益 | 7.4.7.18 | - | - |
| 股利收益 | 7.4.7.19 | - | - |
| 其他投资收益 | | - | - |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7.4.7.20 | 8,526,447.57 | -9,982,933.60 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列） | 7.4.7.21 | 34,289.43 | 18,643.65 |
| 减：二、营业总支出 | | 5,375,466.68 | 6,838,390.71 |
| 1. 管理人报酬 | 7.4.10.2.1 | 1,642,210.65 | 2,004,609.23 |
| 2. 托管费 | 7.4.10.2.2 | 437,922.86 | 534,562.51 |
| 3. 销售服务费 | 7.4.10.2.3 | 101,457.82 | 18,967.49 |
| 4. 投资顾问费 | | - | - |
| 5. 利息支出 | | 2,899,503.50 | 3,965,252.26 |
| 其中：卖出回购金融资产 支出 | | 2,899,503.50 | 3,965,252.26 |
| 6. 信用减值损失 | 7.4.7.22 | - | - |
| 7. 税金及附加 | | 46,912.91 | 69,186.87 |
| 8. 其他费用 | 7.4.7.23 | 247,458.94 | 245,812.35 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 32,888,928.95 | 11,421,907.19 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 32,888,928.95 | 11,421,907.19 |
| 五、其他综合收益的税后净额 | | - | - |
| 六、综合收益总额 | | 32,888,928.95 | 11,421,907.19 |

7.3 净资产变动表

会计主体：长盛盛康纯债债券型证券投资基金

本报告期：2023年1月1日至2023年12月31日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----|----|
|----|----|

| | 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日 | | |
|--|---|-----------------|-------------------|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产 | 676,677,834.06 | 64,065,822.78 | 740,743,656.84 |
| 二、本期期初净资产 | 676,677,834.06 | 64,065,822.78 | 740,743,656.84 |
| 三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列) | -510,376,586.77 | -39,781,361.31 | -550,157,948.08 |
| (一)、综合收益总额 | - | 32,888,928.95 | 32,888,928.95 |
| (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) | -510,376,586.77 | -72,670,290.26 | -583,046,877.03 |
| 其中: 1. 基金申购款 | 705,307,022.73 | 89,057,563.43 | 794,364,586.16 |
| 2. 基金赎回款 | -1,215,683,609.50 | -161,727,853.69 | -1,377,411,463.19 |
| (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 | 166,301,247.29 | 24,284,461.47 | 190,585,708.76 |
| 项目 | 上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 | | |
| | 实收基金 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产 | 286,731,390.86 | 20,731,021.11 | 307,462,411.97 |
| 二、本期期初净资产 | 286,731,390.86 | 20,731,021.11 | 307,462,411.97 |
| 三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列) | 389,946,443.20 | 43,334,801.67 | 433,281,244.87 |
| (一)、综合收益总额 | - | 11,421,907.19 | 11,421,907.19 |
| (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) | 389,946,443.20 | 31,912,894.48 | 421,859,337.68 |
| 其中: 1. 基金申购款 | 1,208,111,465.79 | 99,234,929.93 | 1,307,346,395.72 |
| 2. 基金赎回款 | -818,165,022.59 | -67,322,035.45 | -885,487,058.04 |

| | | | |
|--|----------------|---------------|----------------|
| （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 | 676,677,834.06 | 64,065,822.78 | 740,743,656.84 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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 |

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

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

根据《关于长盛盛康纯债债券型证券投资基金增加 D 类基金份额并修改基金合同等法律文件的公告》以及更新的《长盛盛康纯债债券型证券投资基金基金合同》，自 2021 年 9 月 2 日起，本基金增加 D 类基金份额。根据《关于长盛盛康纯债债券型证券投资基金增加 E 类基金份额并修改基金合同等法律文件的公告》以及更新的《长盛盛康纯债债券型证券投资基金基金合同》，自 2023 年 11 月 6 日起，本基金增加 E 类基金份额。本基金根据申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者申购时收取申购费用、但不从本类别基金资产中计提销售服务费的，包括 A 类基金份额、D 类基金份额和 E 类基金份额；在投资者申购时不收取申购费用、而是从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类、D 类和 E 类基金份额分别设置代码，各类基金份额分别计算基金份额净值。投资人可自由选择申购某一类

别的基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛盛康纯债债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为固定收益类金融工具，具体包括：国债、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债、分离交易可转债的纯债部分、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、中小企业私募债等债券，以及资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款、通知存款及其他银行存款）、现金等固定收益类金融工具，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金不投资于股票、权证等权益类资产。本基金投资组合中债券投资占基金资产的比例不低于 80%；在每个交易日日终，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中债综合指数（全价）收益率。

本财务报表由本基金的基金管理人长盛基金管理有限公司于 2024 年 3 月 27 日批准报出。

7.4.2 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》、《长盛盛康纯债债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2023 年度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 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 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。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 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商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

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

以摊余成本计量：

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

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

权益工具

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

(2) 金融负债

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

(3) 衍生金融工具

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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。

7.4.4.5 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。

7.4.4.6 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。

7.4.4.7 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。

7.4.4.8 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)。

7.4.4.9 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。

7.4.4.10 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。

7.4.4.11 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。

7.4.4.12 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。

7.4.4.13 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《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、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。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 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。

7.4.6 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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位: 人民币元

| 项目 | 本期末 2023 年 12 月 31 日 | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 |
|-----------------|-------------------------|--------------------------|
| 活期存款 | 2,768,634.48 | 701,626.36 |
| 等于: 本金 | 2,767,816.42 | 699,470.66 |
| 加: 应计利息 | 818.06 | 2,155.70 |
| 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 | 2,768,634.48 | 701,626.36 |

7.4.7.2 交易性金融资产

单位: 人民币元

| 项目 | 本期末 2023 年 12 月 31 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 | 17,993,435.87 | 365,390.28 | 18,296,537.78 | -62,288.37 |
| | 银行间市场 | 167,725,627.29 | 2,206,722.50 | 170,505,592.50 | 573,242.71 |
| | 合计 | 185,719,063.16 | 2,572,112.78 | 188,802,130.28 | 510,954.34 |
| 资产支持证券 | - | - | - | - | |

| | | | | | |
|---------------|---------------------|----------------|----------------|----------------|---------------|
| 基金 | - | - | - | - | |
| 其他 | - | - | - | - | |
| 合计 | 185,719,063.16 | 2,572,112.78 | 188,802,130.28 | 510,954.34 | |
| 项目 | 上年度末 2022年12月31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 | 486,657,413.06 | 7,880,695.39 | 491,046,390.39 | -3,491,718.06 |
| | 银行间市场 | 476,773,197.83 | 8,179,879.31 | 480,509,779.31 | -4,443,297.83 |
| | 合计 | 963,430,610.89 | 16,060,574.70 | 971,556,169.70 | -7,935,015.89 |
| 资产支持证券 | 13,189,577.34 | 37,616.65 | 13,146,716.65 | -80,477.34 | |
| 基金 | - | - | - | - | |
| 其他 | - | - | - | - | |
| 合计 | 976,620,188.23 | 16,098,191.35 | 984,702,886.35 | -8,015,493.23 | |

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

7.4.7.5 债权投资

无。

7.4.7.6 其他债权投资

无。

7.4.7.7 其他权益工具投资

无。

7.4.7.8 其他资产

无。

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 | 上年度末 |
|----|-----|------|
|----|-----|------|

| | 2023 年 12 月 31 日 | 2022 年 12 月 31 日 |
|-------------|------------------|------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - | - |
| 应付赎回费 | 97.11 | 41.74 |
| 应付证券出借违约金 | - | - |
| 应付交易费用 | 13,246.50 | 17,514.84 |
| 其中：交易所市场 | - | - |
| 银行间市场 | 13,246.50 | 17,514.84 |
| 应付利息 | - | - |
| 预提费用 | 189,000.00 | 189,000.00 |
| 合计 | 202,343.61 | 206,556.58 |

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

长盛盛康纯债 A

| 项目 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日 | |
|---------------|--|-----------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 660,828,984.48 | 660,828,984.48 |
| 本期申购 | 128,645,249.78 | 128,645,249.78 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -708,202,663.74 | -708,202,663.74 |
| 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 | 81,271,570.52 | 81,271,570.52 |

长盛盛康纯债 C

| 项目 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日 | |
|---------------|--|-----------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 14,191,394.49 | 14,191,394.49 |
| 本期申购 | 552,439,686.69 | 552,439,686.69 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -487,460,432.05 | -487,460,432.05 |
| 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 | 79,170,649.13 | 79,170,649.13 |

长盛盛康纯债 D

| 项目 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日 | |
|---------------|--|----------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 1,657,455.09 | 1,657,455.09 |
| 本期申购 | 23,463,367.73 | 23,463,367.73 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -20,020,496.25 | -20,020,496.25 |

| | | |
|---------------|--------------|--------------|
| 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 | 5,100,326.57 | 5,100,326.57 |

长盛盛康纯债 E

| 项目 | 本期 2023 年 11 月 6 日至 2023 年 12 月 31 日 | |
|---------------|---|------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | - | - |
| 本期申购 | 758,718.53 | 758,718.53 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -17.46 | -17.46 |
| 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 | 758,701.07 | 758,701.07 |

注：1、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。

2、本基金自 2023 年 11 月 6 日起增加 E 类基金份额类别。

7.4.7.11 其他综合收益

无。

7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

长盛盛康纯债 A

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|----------------|----------------|----------------|
| 上年度末 | 28,004,972.15 | 34,728,624.40 | 62,733,596.55 |
| 本期期初 | 28,004,972.15 | 34,728,624.40 | 62,733,596.55 |
| 本期利润 | 18,471,512.31 | 10,312,978.50 | 28,784,490.81 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -39,691,676.41 | -39,421,419.70 | -79,113,096.11 |
| 其中：基金申购款 | 9,808,567.53 | 8,439,247.72 | 18,247,815.25 |
| 基金赎回款 | -49,500,243.94 | -47,860,667.42 | -97,360,911.36 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 6,784,808.05 | 5,620,183.20 | 12,404,991.25 |

长盛盛康纯债 C

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|--------------|---------------|--------------|
| 上年度末 | 353,210.37 | 821,722.78 | 1,174,933.15 |
| 本期期初 | 353,210.37 | 821,722.78 | 1,174,933.15 |
| 本期利润 | 5,596,874.63 | -1,724,950.22 | 3,871,924.41 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -848,692.45 | 6,786,482.55 | 5,937,790.10 |

| | | | |
|----------|----------------|----------------|----------------|
| 其中：基金申购款 | 26,976,831.54 | 40,524,013.12 | 67,500,844.66 |
| 基金赎回款 | -27,825,523.99 | -33,737,530.57 | -61,563,054.56 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 5,101,392.55 | 5,883,255.11 | 10,984,647.66 |

长盛盛康纯债 D

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|---------------|---------------|---------------|
| 上年度末 | 70,186.97 | 87,106.11 | 157,293.08 |
| 本期期初 | 70,186.97 | 87,106.11 | 157,293.08 |
| 本期利润 | 292,526.98 | -62,990.65 | 229,536.33 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 63,597.68 | 328,282.60 | 391,880.28 |
| 其中：基金申购款 | 1,586,251.43 | 1,609,514.05 | 3,195,765.48 |
| 基金赎回款 | -1,522,653.75 | -1,281,231.45 | -2,803,885.20 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 426,311.63 | 352,398.06 | 778,709.69 |

长盛盛康纯债 E

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|-----------|-----------|------------|
| 上年度末 | - | - | - |
| 本期期初 | - | - | - |
| 本期利润 | 1,567.46 | 1,409.94 | 2,977.40 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 62,050.27 | 51,085.20 | 113,135.47 |
| 其中：基金申购款 | 62,051.68 | 51,086.36 | 113,138.04 |
| 基金赎回款 | -1.41 | -1.16 | -2.57 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 63,617.73 | 52,495.14 | 116,112.87 |

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|-----------|-----------------------|-----------------------|
| | 2023年1月1日至2023年12月31日 | 2022年1月1日至2022年12月31日 |
| 活期存款利息收入 | 79,260.66 | 61,683.61 |
| 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 | 38,610.39 | 63,320.11 |
| 其他 | 294.69 | 111.33 |
| 合计 | 118,165.74 | 125,115.05 |

7.4.7.14 股票投资收益

无。

7.4.7.15 债券投资收益

7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年1月1日至2023年12月31日 | 上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日 |
|------------------------------|-----------------------------|----------------------------------|
| 债券投资收益——利息收入 | 24,035,667.24 | 30,972,677.59 |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 5,223,368.98 | -3,687,810.27 |
| 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 | 29,259,036.22 | 27,284,867.32 |

7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年1月1日至2023年12月31日 | 上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日 |
|------------------------|-----------------------------|----------------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额 | 2,412,425,506.03 | 867,623,476.68 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 2,375,699,465.55 | 860,905,035.64 |
| 减：应计利息总额 | 31,456,935.75 | 10,382,036.99 |
| 减：交易费用 | 45,735.75 | 24,214.32 |
| 买卖债券差价收入 | 5,223,368.98 | -3,687,810.27 |

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年1月1日至2023年12月31日 | 上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日 |
|--------------------------|-----------------------------|----------------------------------|
| 资产支持证券投资收益——利息收入 | 249,116.47 | 469,176.95 |
| 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入 | 15,292.77 | 73,062.27 |

| | | |
|------------------------|------------|------------|
| 资产支持证券投资收益— —赎回差价收入 | - | - |
| 资产支持证券投资收益— —申购差价收入 | - | - |
| 合计 | 264,409.24 | 542,239.22 |

7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年1月1日至2023年12月 31日 | 上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月 31日 |
|--------------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 卖出资产支持证券成交总 额 | 13,270,099.70 | 10,176,393.25 |
| 减：卖出资产支持证券成 本总额 | 13,189,577.34 | 9,735,937.73 |
| 减：应计利息总额 | 65,229.59 | 367,393.25 |
| 减：交易费用 | - | - |
| 资产支持证券投资收益 | 15,292.77 | 73,062.27 |

7.4.7.17 贵金属投资收益

无。

7.4.7.18 衍生工具收益

无。

7.4.7.19 股利收益

无。

7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 2023年1月1日至2023年 12月31日 | 上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年12月31日 |
|----------------------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | 8,526,447.57 | -9,982,933.60 |
| 股票投资 | - | - |
| 债券投资 | 8,445,970.23 | -9,817,971.33 |
| 资产支持证券投资 | 80,477.34 | -164,962.27 |
| 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 | 8,526,447.57 | -9,982,933.60 |
|----|--------------|---------------|

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年1月1日至2023年12月31日 | 上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日 |
|---------|-----------------------------|----------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 34,222.13 | 18,573.35 |
| 基金转换费收入 | 67.30 | 70.30 |
| 合计 | 34,289.43 | 18,643.65 |

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

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

7.4.7.22 信用减值损失

无。

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年1月1日至2023年12月31日 | 上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日 |
|---------|-----------------------------|----------------------------------|
| 审计费用 | 60,000.00 | 60,000.00 |
| 信息披露费 | 120,000.00 | 120,000.00 |
| 证券出借违约金 | - | - |
| 银行费用 | 30,408.94 | 28,662.35 |
| 账户维护费 | 35,850.00 | 35,950.00 |
| 其他 | 1,200.00 | 1,200.00 |
| 合计 | 247,458.94 | 245,812.35 |

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

7.4.9 关联方关系

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|----------------------|---------------------|
| 长盛基金管理有限公司（“长盛基金公司”） | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 交通银行股份有限公司（“交通银行”） | 基金托管人、基金销售机构 |
| 国元证券股份有限公司（“国元证券”） | 基金管理人的股东、基金销售机构 |
| 新加坡星展银行有限公司（“星展银行”） | 基金管理人的股东 |

| | |
|------------------|---------------|
| 安徽省投资集团控股有限公司 | 基金管理人的股东 |
| 安徽省信用融资担保集团有限公司 | 基金管理人的股东 |
| 长盛创富资产管理有限公司 | 基金管理人的全资子公司 |
| 长盛基金（香港）有限公司 | 基金管理人的全资子公司 |
| 国元期货有限公司（“国元期货”） | 基金管理人股东的控股子公司 |

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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|------------------|-----------------------|-----------------------|
| | 2023年1月1日至2023年12月31日 | 2022年1月1日至2022年12月31日 |
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 1,642,210.65 | 2,004,609.23 |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 148,772.48 | 29,320.18 |
| 应支付基金管理人的净管理费 | 1,493,438.17 | 1,975,289.05 |

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

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----------------|-----------------------|-----------------------|
| | 2023年1月1日至2023年12月31日 | 2022年1月1日至2022年12月31日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 437,922.86 | 534,562.51 |

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 0.08% 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

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期 2023年1月1日至2023年12月31日 | | | | |
|----------------|----------------------------------|-------------|-------------|-------------|----------|
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | | | |
| | 长盛盛康纯债 A | 长盛盛康纯债 C | 长盛盛康纯债 D | 长盛盛康纯债 E | 合计 |
| 长盛基金公司 | - | 595.40 | - | - | 595.40 |
| 交通银行 | - | 1,145.84 | - | - | 1,145.84 |
| 国元证券 | - | 555.15 | - | - | 555.15 |
| 合计 | - | 2,296.39 | - | - | 2,296.39 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日 | | | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | | | |
| | 长盛盛康纯债 A | 长盛盛康纯债 C | 长盛盛康纯债 D | 长盛盛康纯债 E | 合计 |
| 长盛基金公司 | - | 57.61 | - | - | 57.61 |
| 交通银行 | - | 516.98 | - | - | 516.98 |
| 合计 | - | 574.59 | - | - | 574.59 |

注：基金销售服务费每日计提，按月支付。本基金 A 类、D 类和 E 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费率为 0.10%。销售服务费计提的计算公式如下：

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

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

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

| 银行间市场交易的各关联方名称 | 本期 2023年1月1日至2023年12月31日 | | | | | |
|----------------|----------------------------------|------|-------|------|-------|------|
| | 债券交易金额 | | 基金逆回购 | | 基金正回购 | |
| | 基金买入 | 基金卖出 | 交易金额 | 利息收入 | 交易金额 | 利息支出 |
| 交通银行 | - | - | - | - | - | - |
| 银行间市场交易的各关联方名称 | 上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日 | | | | | |
| | 债券交易金额 | | 基金逆回购 | | 基金正回购 | |
| | 基金买入 | 基金卖出 | 交易金额 | 利息收入 | 交易金额 | 利息支出 |
| 交通银行 | 10,150,356.30 | - | - | - | - | - |

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

长盛盛康纯债 A

| 关联方名称 | 本期末 2023年12月31日 | | 上年度末 2022年12月31日 | |
|-------|--------------------|---------------------------------|---------------------|---------------------------------|
| | 持有的 基金份额 | 持有的基金份额 占基金总份 额的比例 (%) | 持有的 基金份额 | 持有的基金份额 占基金总份 额的比例 (%) |
| 国元期货 | 35,092,998.77 | 43.1799 | - | - |

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

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2023年1月1日至2023年12月 31日 | | 上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日 | |
|-------|---------------------------------|-----------|----------------------------------|-----------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 交通银行 | 2,768,634.48 | 79,260.66 | 701,626.36 | 61,683.61 |
| 合计 | 2,768,634.48 | 79,260.66 | 701,626.36 | 61,683.61 |

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行约定利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

无。

7.4.12 期末（2023 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人交通银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

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

7.4.13.2.1 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 2023 年 12 月 31 日 | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|--------------------------|
| A-1 | - | - |
| A-1 以下 | - | - |
| 未评级 | 40,662,226.42 | 7,448,357.48 |
| 合计 | 40,662,226.42 | 7,448,357.48 |

注：未评级部分为国债、企业超短期融资券、短期融资券。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末 2023 年 12 月 31 日 | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|--------------------------|
| A-1 | - | 12,955,525.75 |
| A-1 以下 | - | - |
| 未评级 | - | - |
| 合计 | - | 12,955,525.75 |

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末 2023 年 12 月 31 日 | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|--------------------------|
| AAA | 78,762,738.96 | 503,196,087.61 |
| AAA 以下 | 17,216,463.12 | 209,118,736.60 |
| 未评级 | 52,160,701.78 | 251,792,988.01 |
| 合计 | 148,139,903.86 | 964,107,812.22 |

注：未评级部分为国债、政策性金融债、中期票据。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末 2023 年 12 月 31 日 | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|--------------------------|
| AAA | - | 191,190.90 |
| AAA 以下 | - | - |
| 未评级 | - | - |
| 合计 | - | 191,190.90 |

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.3 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 2023 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 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公司的证券不得超过该证券的 10%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，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 7.4.12。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 2023 年 12 月 31 日，本基金无流动性受限资产。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2023 年 12 月 31 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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 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 | 2,767,816.42 | - | - | 818.06 | 2,768,634.48 |
| 结算备付金 | 39,799.86 | - | - | 17.90 | 39,817.76 |

| | | | | | |
|--------------------------|-----------------|----------------|---------------|---------------|----------------|
| 存出保证金 | 30,271.00 | - | - | 13.60 | 30,284.60 |
| 交易性金融资产 | 142,509,457.50 | 43,720,560.00 | - | 2,572,112.78 | 188,802,130.28 |
| 应收申购款 | - | - | - | 1,036,695.57 | 1,036,695.57 |
| 资产总计 | 145,347,344.78 | 43,720,560.00 | - | 3,609,657.91 | 192,677,562.69 |
| 负债 | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | 1,821,100.73 | 1,821,100.73 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 39,134.45 | 39,134.45 |
| 应付托管费 | - | - | - | 10,435.85 | 10,435.85 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 6,870.26 | 6,870.26 |
| 应交税费 | - | - | - | 11,969.03 | 11,969.03 |
| 其他负债 | - | - | - | 202,343.61 | 202,343.61 |
| 负债总计 | - | - | - | 2,091,853.93 | 2,091,853.93 |
| 利率敏感度缺口 | 145,347,344.78 | 43,720,560.00 | - | 1,517,803.98 | 190,585,708.76 |
| 上年度末 2022 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 | 699,470.66 | - | - | 2,155.70 | 701,626.36 |
| 结算备付金 | 5,239,217.25 | - | - | 2,357.70 | 5,241,574.95 |
| 存出保证金 | 4,894.51 | - | - | 2.20 | 4,896.71 |
| 交易性金融资产 | 111,956,520.00 | 764,737,175.00 | 91,911,000.00 | 16,098,191.35 | 984,702,886.35 |
| 应收申购款 | - | - | - | 754,266.28 | 754,266.28 |
| 应收清算款 | - | - | - | 603,065.16 | 603,065.16 |
| 资产总计 | 117,900,102.42 | 764,737,175.00 | 91,911,000.00 | 17,460,038.39 | 992,008,315.81 |
| 负债 | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | 185,830.39 | 185,830.39 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 189,134.51 | 189,134.51 |
| 应付托管费 | - | - | - | 50,435.89 | 50,435.89 |
| 应付清算款 | - | - | - | 978,198.68 | 978,198.68 |
| 卖出回购金融资产款 | 249,552,136.60 | - | - | 47,331.13 | 249,599,467.73 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 1,403.87 | 1,403.87 |
| 应交税费 | - | - | - | 53,631.32 | 53,631.32 |
| 其他负债 | - | - | - | 206,556.58 | 206,556.58 |
| 负债总计 | 249,552,136.60 | - | - | 1,712,522.37 | 251,264,658.97 |
| 利率敏感度缺口 | -131,652,034.18 | 764,737,175.00 | 91,911,000.00 | 15,747,516.02 | 740,743,656.84 |

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。

7.4.13.4.1.2 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（2023 年 12 月 31 日） | 上年度末（2022 年 12 月 |

| | | | |
|---------------------|--|-------------|---------------|
| | | | 31 日) |
| 1. 市场利率下降 25 个基点 | | 363,434.13 | 4,997,706.90 |
| 2. 市场利率上升 25 个基点 | | -363,434.13 | -4,997,706.90 |

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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。

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末 2023 年 12 月 31 日 | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 |
|---------------|-------------------------|--------------------------|
| 第一层次 | - | - |
| 第二层次 | 188,802,130.28 | 984,702,886.35 |
| 第三层次 | - | - |
| 合计 | 188,802,130.28 | 984,702,886.35 |

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

无。

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2022 年 12 月 31 日：同)。

7.4.14.4 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。

7.4.15 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。

§ 8 投资组合报告**8.1 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 | 188,802,130.28 | 97.99 |
| | 其中：债券 | 188,802,130.28 | 97.99 |
| | 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 | 2,808,452.24 | 1.46 |
| 8 | 其他各项资产 | 1,066,980.17 | 0.55 |
| 9 | 合计 | 192,677,562.69 | 100.00 |

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合**8.2.1 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。

8.2.2 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。

8.3 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。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期内未进行股票投资。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期内未进行股票投资。

8.4.3 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。

8.5 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 | 10,052,328.77 | 5.27 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 35,864,522.95 | 18.82 |
| | 其中：政策性金融债 | 10,231,000.00 | 5.37 |
| 4 | 企业债券 | 21,053,926.99 | 11.05 |
| 5 | 企业短期融资券 | 30,609,897.65 | 16.06 |
| 6 | 中期票据 | 91,221,453.92 | 47.86 |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 188,802,130.28 | 99.06 |

8.6 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 | 102380517 | 23 广州凯得 MTN001 (科创票据) | 100,000 | 10,347,708.20 | 5.43 |
| 2 | 102000934 | 20 长发集团 MTN001 | 100,000 | 10,334,327.87 | 5.42 |
| 3 | 1928018 | 19 工商银行永续债 | 100,000 | 10,283,765.03 | 5.40 |
| 4 | 102381833 | 23 湖北路桥 MTN003 (科创) | 100,000 | 10,265,606.56 | 5.39 |

| | | | | | |
|---|---------|-------------------|---------|---------------|------|
| | | 票据) | | | |
| 5 | 1928021 | 19 农业银行永 续债 01 | 100,000 | 10,260,581.42 | 5.38 |

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.10.1 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。

8.10.2 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。

8.11 投资组合报告附注

8.11.1 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

19 农业银行永续债 01

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。

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

8.11.2 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。

8.11.3 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 | 30,284.60 |
| 2 | 应收清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |

| | | |
|---|-------|--------------|
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 1,036,695.57 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 1,066,980.17 |

8.11.4 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。

8.11.5 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。

8.11.6 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额级别 | 持有人户数 (户) | 户均持有的基金份额 | 持有人结构 | | | |
|----------|-----------|------------|---------------|------------|---------------|------------|
| | | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | | 持有份额 | 占总份额比例 (%) | 持有份额 | 占总份额比例 (%) |
| 长盛盛康纯债 A | 714 | 113,825.73 | 69,617,912.34 | 85.66 | 11,653,658.18 | 14.34 |
| 长盛盛康纯债 C | 4,216 | 18,778.62 | 44,381.32 | 0.06 | 79,126,267.81 | 99.94 |
| 长盛盛康纯债 D | 25 | 204,013.06 | - | - | 5,100,326.57 | 100.00 |
| 长盛盛康纯债 E | 25 | 30,348.04 | - | - | 758,701.07 | 100.00 |
| 合计 | 4,980 | 33,393.82 | 69,662,293.66 | 41.89 | 96,638,953.63 | 58.11 |

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。

9.2 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 | 长盛盛康纯债 A | 12,584.50 | 0.0155 |

| | | | |
|---------------|----------|-----------|--------|
| 理人所有从业人员持有本基金 | 长盛盛康纯债 C | 676.42 | 0.0009 |
| | 长盛盛康纯债 D | 0.00 | 0.0000 |
| | 长盛盛康纯债 E | 1,049.24 | 0.1383 |
| | 合计 | 14,310.16 | 0.0086 |

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。

9.3 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、基金投资和部门负责人持有本开放式基金 | 长盛盛康纯债 A | 0~10 |
| | 长盛盛康纯债 C | 0 |
| | 长盛盛康纯债 D | 0 |
| | 长盛盛康纯债 E | 0 |
| | 合计 | 0~10 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 长盛盛康纯债 A | 0 |
| | 长盛盛康纯债 C | 0 |
| | 长盛盛康纯债 D | 0 |
| | 长盛盛康纯债 E | 0 |
| | 合计 | 0 |

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 长盛盛康纯债 A | 长盛盛康纯债 C | 长盛盛康纯债 D | 长盛盛康纯债 E |
|----------------------------|----------------|----------------|---------------|------------|
| 基金合同生效日（2018年12月20日）基金份额总额 | 41,635.71 | 49,732,485.30 | - | - |
| 本报告期期初基金份额总额 | 660,828,984.48 | 14,191,394.49 | 1,657,455.09 | - |
| 本报告期基金总申购份额 | 128,645,249.78 | 552,439,686.69 | 23,463,367.73 | 758,718.53 |
| 减：本报告期基金总 | 708,202,663.74 | 487,460,432.05 | 20,020,496.25 | 17.46 |

| | | | | |
|--------------|---------------|---------------|--------------|------------|
| 赎回份额 | | | | |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - | - | - | - |
| 本报告期末基金份额总额 | 81,271,570.52 | 79,170,649.13 | 5,100,326.57 | 758,701.07 |

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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

11.2.1 本基金管理人的高级管理人员重大人事变动情况

根据公司 2023 年 2 月 18 日召开的第八届董事会相关会议决议，选举胡甲先生担任公司董事长，同时代行公司总经理职务，代行总经理职务期限不超 6 个月；高民和先生不再担任公司董事长，周兵先生不再担任公司总经理职务。公司已按规定向相关监管机构报备并进行公告。

根据公司 2023 年 8 月 30 日召开的第八届董事会相关会议决议，聘任汤琰女士担任公司总经理，董事长胡甲先生不再代为履行公司总经理职务。公司已按规定向相关监管机构报告并发布变更公告。

11.2.2 基金经理的变动情况

报经中国证券投资基金业协会同意，自 2023 年 9 月 19 日起，张建同志担任长盛盛康纯债债券型证券投资基金基金经理；自 2023 年 9 月 22 日起，李琪同志不再担任长盛盛康纯债债券型证券投资基金基金经理。

11.2.3 本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动情况

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 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。

11.4 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。

11.5 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，本报告期应支付给该会计师事务所的报酬 60,000.00 元，已连续为本基金提供审计服务 7 年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

11.6.2 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稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|------|--------|------|------------------|-----------|----------------|----|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 (%) | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 (%) | |
| 长江证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 川财证券 | 2 | - | - | - | - | - |

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 债券回购交易 | | 权证交易 | |
|------|----------------|------------------|------------------|--------------------|------|------------------|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 (%) | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 (%) | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 (%) |
| 长江证券 | - | - | - | - | - | - |
| 川财证券 | 730,387,206.40 | 100.00 | 4,254,585,000.00 | 100.00 | - | - |

注：1、本公司选择证券经营机构的标准

(1) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时为本公司提供高质量的咨询

服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告等，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

(2) 资力雄厚，信誉良好。

(3) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定。

(4) 经营行为规范，最近两年未因重大违规行为而受到中国证监会和中国人民银行处罚。

(5) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求。

(6) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本公司基金进行证券交易的需要，并能为本公司基金提供全面的信息服务。

2、本公司租用券商交易单元的程序

(1) 研究机构提出服务意向，并提供相关研究报告；

(2) 研究机构的研究报告需要有一定的试用期。试用期视服务情况和研究服务评价结果而定；

(3) 研究、投资管理等部门试用研究机构的研究报告后，按照研究服务评价规定，对研究机构进行综合评价；

(4) 试用期满后，评价结果符合条件，双方认为有必要继续合作，经公司领导审批后，我司与研究机构签定《研究服务协议》、《券商交易单元租用协议》，并办理基金专用交易单元租用手续。评价结果如不符合条件则终止试用；

(5) 本公司每两个月对签约机构的服务进行一次综合评价。经过评价，若本公司认为签约机构的服务不能满足要求，或签约机构违规受到国家有关部门的处罚，本公司有权终止签署的协议，并撤销租用的交易单元；

(6) 交易单元租用协议期限为一年，到期后若双方没有异议可自动延期一年。

3、本基金租用证券公司交易单元为共用交易单元。

4、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

(1) 本基金报告期内新增租用交易单元情况：无。

(2) 本基金报告期内停止租用交易单元情况：无。

11.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
|----|--|-------------|------------|
| 1 | 长盛盛康纯债债券型证券投资基金暂停大额申购、转换转入、定期定额投资业务的公告 | 中国证监会指定披露媒介 | 2023年1月10日 |
| 2 | 长盛基金管理有限公司旗下基金2022年4季度报告提示性公告 | 中国证监会指定披露媒介 | 2023年1月20日 |
| 3 | 长盛盛康纯债债券型证券投资基金 | 中国证监会指定披露媒介 | 2023年1月20日 |

| | | | |
|----|---|-------------|-----------------|
| | 2022 年第 4 季度报告 | 介 | |
| 4 | 长盛基金管理有限公司关于部分产品增加代销机构的公告 | 中国证监会指定披露媒介 | 2023 年 2 月 8 日 |
| 5 | 长盛基金管理有限公司关于旗下基金增加华瑞保险为销售机构并参加费率优惠活动的公告 | 中国证监会指定披露媒介 | 2023 年 3 月 8 日 |
| 6 | 长盛基金管理有限公司高级管理人员变更的公告 | 中国证监会指定披露媒介 | 2023 年 3 月 15 日 |
| 7 | 长盛基金管理有限公司关于旗下产品增加代销机构的公告 | 中国证监会指定披露媒介 | 2023 年 3 月 28 日 |
| 8 | 长盛盛康纯债债券型证券投资基金 2022 年年度报告 | 中国证监会指定披露媒介 | 2023 年 3 月 31 日 |
| 9 | 长盛基金管理有限公司关于终止部分基金销售机构办理旗下基金销售业务的公告 | 中国证监会指定披露媒介 | 2023 年 3 月 31 日 |
| 10 | 长盛基金管理有限公司旗下基金 2022 年年度报告提示性公告 | 中国证监会指定披露媒介 | 2023 年 3 月 31 日 |
| 11 | 长盛基金管理有限公司关于旗下基金参与平安银行股份有限公司费率优惠活动的公告 | 中国证监会指定披露媒介 | 2023 年 4 月 17 日 |
| 12 | 长盛基金管理有限公司旗下基金 2023 年第 1 季度报告提示性公告 | 中国证监会指定披露媒介 | 2023 年 4 月 22 日 |
| 13 | 长盛盛康纯债债券型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告 | 中国证监会指定披露媒介 | 2023 年 4 月 22 日 |
| 14 | 长盛基金管理有限公司关于旗下基金参与平安银行股份有限公司费率优惠活动的公告 | 中国证监会指定披露媒介 | 2023 年 5 月 5 日 |
| 15 | 长盛盛康纯债债券型证券投资基金恢复大额申购、转换转入、定期定额投资业务的公告 | 中国证监会指定披露媒介 | 2023 年 6 月 1 日 |
| 16 | 长盛基金管理有限公司关于增加国元证券为旗下部分开放式基金代销机构及开通基金定投业务与转换业务的公告 | 中国证监会指定披露媒介 | 2023 年 6 月 7 日 |
| 17 | 长盛基金管理有限公司关于部分基金增加销售机构的公告 | 中国证监会指定披露媒介 | 2023 年 6 月 28 日 |
| 18 | 长盛盛康纯债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 | 2023 年 7 月 11 日 |
| 19 | 长盛基金管理有限公司关于增加陆金所为旗下部分产品销售机构的公告 | 中国证监会指定披露媒介 | 2023 年 7 月 11 日 |
| 20 | 长盛盛康纯债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 | 2023 年 7 月 11 日 |
| 21 | 长盛基金管理有限公司关于旗下基金增加招商银行为代销机构并参与费率 | 中国证监会指定披露媒介 | 2023 年 7 月 19 日 |

| | | | |
|----|--|-------------|------------------|
| | 优惠活动的公告 | | |
| 22 | 长盛基金管理有限公司关于增加国金证券为旗下部分开放式基金代销机构及开通基金定投业务与转换业务的公告 | 中国证监会指定披露媒介 | 2023 年 7 月 21 日 |
| 23 | 长盛基金管理有限公司旗下基金 2023 年第 2 季度报告提示性公告 | 中国证监会指定披露媒介 | 2023 年 7 月 21 日 |
| 24 | 长盛盛康纯债债券型证券投资基金 2023 年第 2 季度报告 | 中国证监会指定披露媒介 | 2023 年 7 月 21 日 |
| 25 | 长盛基金管理有限公司关于旗下基金参加国元证券费率优惠活动的公告 | 中国证监会指定披露媒介 | 2023 年 8 月 10 日 |
| 26 | 长盛基金管理有限公司关于部分产品增加销售机构的公告 | 中国证监会指定披露媒介 | 2023 年 8 月 25 日 |
| 27 | 长盛基金管理有限公司关于增加博时财富为旗下部分开放式基金代销机构及开通基金定投、转换及费率优惠业务的公告 | 中国证监会指定披露媒介 | 2023 年 8 月 29 日 |
| 28 | 长盛盛康纯债债券型证券投资基金 2023 年中期报告 | 中国证监会指定披露媒介 | 2023 年 8 月 30 日 |
| 29 | 长盛基金管理有限公司旗下基金 2023 年中期报告提示性公告 | 中国证监会指定披露媒介 | 2023 年 8 月 30 日 |
| 30 | 长盛基金管理有限公司高级管理人员变更的公告 | 中国证监会指定披露媒介 | 2023 年 9 月 1 日 |
| 31 | 长盛基金管理有限公司关于调整长盛盛康纯债债券型证券投资基金基金经理的公告 | 中国证监会指定披露媒介 | 2023 年 9 月 21 日 |
| 32 | 长盛盛康纯债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 | 2023 年 9 月 22 日 |
| 33 | 长盛盛康纯债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 | 2023 年 9 月 22 日 |
| 34 | 长盛基金管理有限公司关于调整长盛盛康纯债债券型证券投资基金基金经理的公告 | 中国证监会指定披露媒介 | 2023 年 9 月 23 日 |
| 35 | 长盛盛康纯债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 | 2023 年 9 月 27 日 |
| 36 | 长盛盛康纯债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 | 2023 年 9 月 27 日 |
| 37 | 长盛基金管理有限公司旗下基金 2023 年第 3 季度报告提示性公告 | 中国证监会指定披露媒介 | 2023 年 10 月 25 日 |
| 38 | 长盛盛康纯债债券型证券投资基金 2023 年第 3 季度报告 | 中国证监会指定披露媒介 | 2023 年 10 月 25 日 |
| 39 | 关于长盛盛康纯债债券型证券投资基金增加 E 类基金份额并修改基金合同等法律文件的公告 | 中国证监会指定披露媒介 | 2023 年 11 月 6 日 |

| | | | |
|----|--------------------------|-------------|-----------------|
| 40 | 长盛盛康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 | 2023 年 11 月 6 日 |
| 41 | 长盛盛康纯债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 | 2023 年 11 月 6 日 |
| 42 | 长盛盛康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 | 2023 年 11 月 6 日 |

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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 | 20230101~20230814 | 656,646,679.48 | - | 656,646,679.48 | - | - |
| | 2 | 20230913~20231231 | - | 35,092,998.77 | - | 35,092,998.77 | 21.10 |
| 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> | | | | | | | |

12.2 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。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

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

13.2 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。

13.3 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3月30日