

# 长盛盛华一年定期开放债券型发起式证券投资基金

## 2024 年年度报告

2024 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：兴业银行股份有限公司

送出日期：2025 年 3 月 29 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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 03 月 28 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。

本年度报告财务资料已经审计，安永华明会计师事务所（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 2024 年 01 月 01 日起至 12 月 31 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                         | 5         |
| 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、基金净值表现及利润分配情况</b>         | <b>6</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 6         |
| 3.2 基金净值表现                              | 7         |
| 3.3 过去三年基金的利润分配情况                       | 9         |
| <b>§ 4 管理人报告</b>                        | <b>9</b>  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 9         |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 10        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 10        |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明             | 11        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 11        |
| 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况                 | 12        |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 13        |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 13        |
| 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       | 13        |
| <b>§ 5 托管人报告</b>                        | <b>13</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 13        |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 14        |
| 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      | 14        |
| <b>§ 6 审计报告</b>                         | <b>14</b> |
| 6.1 审计报告基本信息                            | 14        |
| 6.2 审计报告的基本内容                           | 14        |
| <b>§ 7 年度财务报表</b>                       | <b>16</b> |
| 7.1 资产负债表                               | 16        |
| 7.2 利润表                                 | 17        |
| 7.3 净资产变动表                              | 19        |
| 7.4 报表附注                                | 20        |
| <b>§ 8 投资组合报告</b>                       | <b>43</b> |

|   |           |
|---|-----------|
| 8.1 期末基金资产组合情况 .....                        | 43        |
| 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....                  | 43        |
| 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 .....     | 43        |
| 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....                   | 43        |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....                  | 44        |
| 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 .....    | 44        |
| 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 ..... | 44        |
| 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 ..... | 44        |
| 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 .....    | 44        |
| 8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....             | 44        |
| 8.11 投资组合报告附注 .....                         | 45        |
| <b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>                  | <b>46</b> |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                 | 46        |
| 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....              | 46        |
| 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 .....      | 47        |
| 9.4 发起式基金发起资金持有份额情况 .....                   | 47        |
| <b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>                 | <b>47</b> |
| <b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>                    | <b>47</b> |
| 11.1 基金份额持有人大会决议 .....                      | 47        |
| 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 .....      | 47        |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....           | 48        |
| 11.4 基金投资策略的改变 .....                        | 48        |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                 | 48        |
| 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 .....         | 48        |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....                | 48        |
| 11.8 其他重大事件 .....                           | 49        |
| <b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>            | <b>50</b> |
| 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 .....    | 50        |
| 12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                   | 50        |
| <b>§ 13 备查文件目录 .....</b>                    | <b>50</b> |
| 13.1 备查文件目录 .....                           | 50        |
| 13.2 存放地点 .....                             | 51        |
| 13.3 查阅方式 .....                             | 51        |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

|            |                        |
|------------|------------------------|
| 基金名称       | 长盛盛华一年定期开放债券型发起式证券投资基金 |
| 基金简称       | 长盛盛华一年定开债券发起式          |
| 基金主代码      | 018247                 |
| 基金运作方式     | 契约型定期开放式               |
| 基金合同生效日    | 2023 年 12 月 4 日        |
| 基金管理人      | 长盛基金管理有限公司             |
| 基金托管人      | 兴业银行股份有限公司             |
| 报告期末基金份额总额 | 510,000,350.14 份       |
| 基金合同存续期    | 不定期                    |

2.2 基金产品说明

|        |  |
|--------|--|
| 投资目标   | 在控制风险和保持资产流动性的基础上，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   | 本基金在封闭期与开放期采取不同的投资策略。（一）封闭期投资策略 1、大类资产配置策略：本基金将在综合判断宏观经济周期、市场资金供需状况、大类资产估值水平对比的基础上，结合政策分析，确定不同投资期限内的大类金融资产配置和债券类属配置。同时通过严格风险评估，及时调整资产组合比例，保持资产配置风险、收益平衡，以稳健提升投资组合回报。 2、债券组合管理策略：（1）利率策略（2）类属配置策略（3）信用策略（4）相对价值策略（5）债券选择策略（6）可转换债券及可交换债券投资策略。 3、国债期货投资策略：本基金在进行国债期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对债券交易市场和期货市场运行趋势的研究，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。 4、信用衍生品投资策略：本基金按照风险管理原则，以风险对冲为目的，参与信用衍生品交易。本基金将根据所持标的债券等固定收益品种的投资策略，审慎开展信用衍生品投资，合理确定信用衍生品的投资金额、期限以及信用风险敞口等。（二）开放期投资策略 开放期内，本基金为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种，防范流动性风险，满足开放期流动性的需求。 |
| 业绩比较基准 | 中债综合指数（全价）收益率  |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金。   |

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   | 兴业银行股份有限公司          |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 张利宁          | 冯萌                  |
|         | 联系电话 | 010-86497608 | 021-52629999-213310 |

|        |      |                                   |                            |
|--------|------|-----------------------------------|----------------------------|
|        | 电子邮箱 | zhangln@csfunds.com.cn            | fengmeng@cib.com.cn        |
| 客户服务电话 |      | 400-888-2666、010-86497888         | 95561                      |
| 传真     |      | 010-86497999                      | 021-62159217               |
| 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         | 福建省福州市台江区江滨中大道 398 号兴业银行大厦 |
| 办公地址   |      | 北京市朝阳区安定路 5 号院 3 号楼中建财富国际中心 3-5 层 | 上海市浦东新区银城路 167 号 4 楼       |
| 邮政编码   |      | 100029                            | 200120                     |
| 法定代表人  |      | 胡甲                                | 吕家进                        |

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 | <a href="http://www.csfunds.com.cn">http://www.csfunds.com.cn</a> |
| 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 | 安永华明会计师事务所(特殊普通合伙) | 北京市东城区东长安街 1 号东方广场东方经贸城安永大楼 16 层  |
| 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 | 2024 年         | 2023 年 12 月 4 日（基金合同生效日）-2023 年 12 月 31 日 |
|---------------|----------------|---|
| 本期已实现收益       | 11,895,661.57  | 901,947.04                                |
| 本期利润          | 16,767,930.07  | 901,947.04                                |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0329         | 0.0018                                    |
| 本期加权平均净值利润率   | 3.23%          | 0.18%                                     |
| 本期基金份额净值增长率   | 3.27%          | 0.18%                                     |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2024 年末        | 2023 年末                                   |
| 期末可供分配利润      | 12,797,608.61  | 901,947.04                                |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0251         | 0.0018                                    |
| 期末基金资产净值      | 527,670,227.25 | 510,902,297.18                            |
| 期末基金份额净值      | 1.0346         | 1.0018                                    |
| 3.1.3 累计期末指标  | 2024 年末        | 2023 年末                                   |
| 基金份额累计净值增长率   | 3.46%          | 0.18%                                     |

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①－③    | ②－④    |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去三个月      | 1.32%    | 0.05%       | 2.23%      | 0.09%         | -0.91% | -0.04% |
| 过去六个月      | 1.65%    | 0.05%       | 2.50%      | 0.10%         | -0.85% | -0.05% |
| 过去一年       | 3.27%    | 0.05%       | 4.98%      | 0.09%         | -1.71% | -0.04% |
| 自基金合同生效起至今 | 3.46%    | 0.05%       | 5.88%      | 0.08%         | -2.42% | -0.03% |

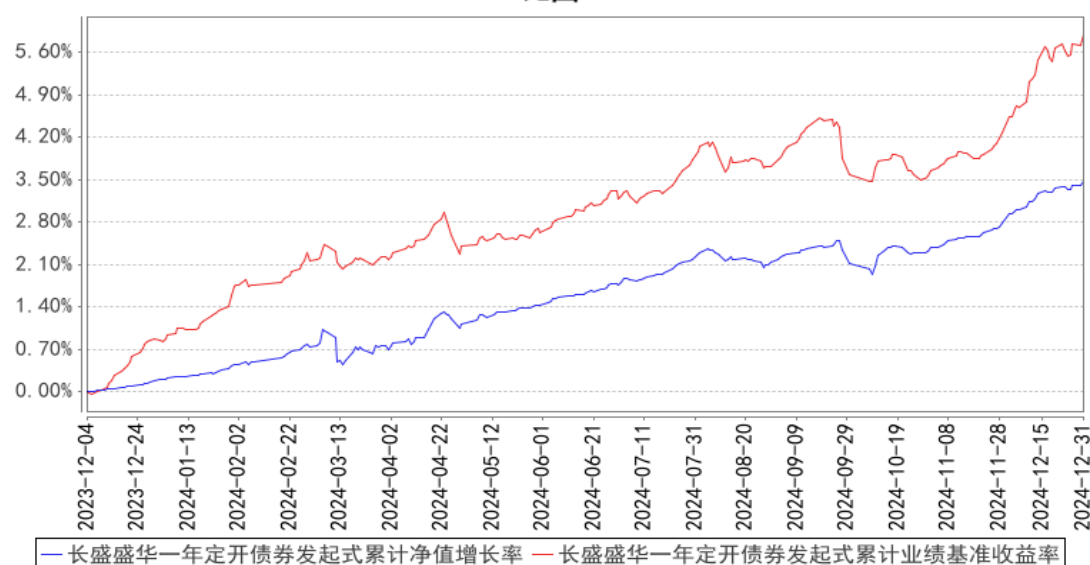
注：本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程：

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

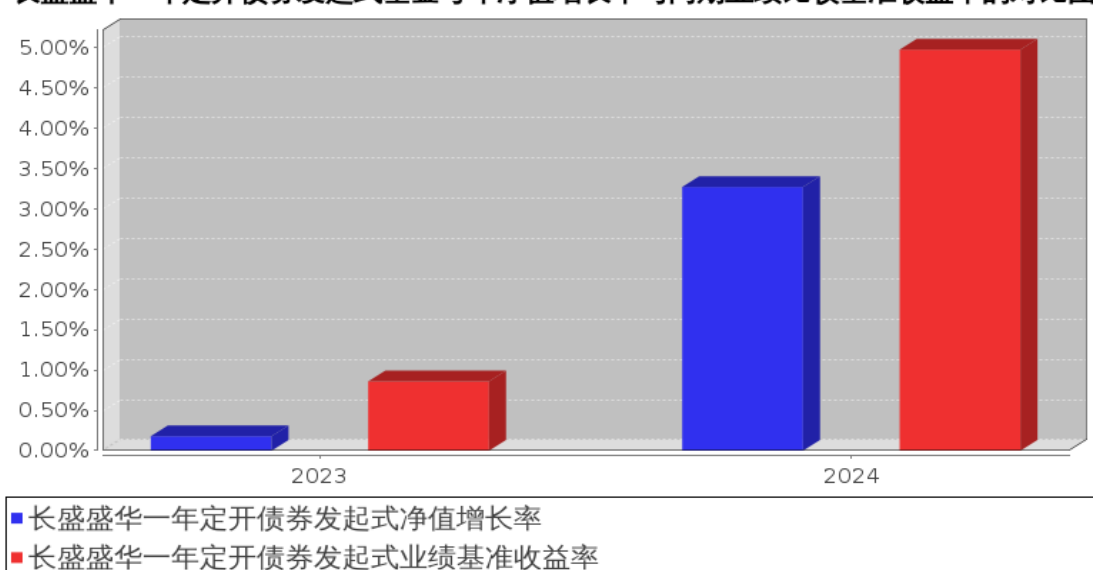
长盛盛华一年定开债券发起式累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：按照本基金合同规定，本基金基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。本基金已完成建仓但报告期末距建仓结束不满一年。截至建仓期结束日，本基金的各项资产配置比例符合本基金合同的有关约定。截至报告日，本基金的各项资产配置比例符合本基金合同的有关约定。

### 3.2.3 自基金合同生效以来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

长盛盛华一年定开债券发起式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：本基金基金合同生效日为 2023 年 12 月 4 日，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。



3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金于2023年12月4日（基金合同生效日）至2024年12月31日期间未进行利润分配。

§ 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 12 月 31 日，基金管理人共管理七十四只开放式基金，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 |        |   |
| 王赛飞 | 本基金基金经理，长盛添利宝货币市场基金基金经理，长盛盛琪一年期定期开放债券型证券投资基金基金经理，长盛中债 0-3 年政策性金融债指数证券投资基金基金经理。 | 2023 年 12 月 4 日 | -    | 12 年   | 王赛飞女士，硕士。曾任大公国际资信评估有限公司分析师、信用评审委员会委员。2015 年 7 月加入长盛基金管理有限公司固定收益部，曾任信用研究员、基金经理助理等职务。 |

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

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

3、报经中国证券投资基金业协会同意，自 2025 年 2 月 20 日起，李琪同志担任长盛盛华一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。

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

报告期内，债券市场表现较为强势，以十年国债为代表的债券收益率出现较大幅度下行。其中 1 至 2 月，资金面较为宽松、经济数据未超预期、机构配置需求较强等因素带动利率下行，3 月地产政策、利率债供给等市场扰动因素增多，利率债波动加大，但整体仍下行。4 月下旬，随着央行对债券收益率风险的提示，收益率一度出现明显调整。但资金面较为宽松、配置压力较大等因素均对债券偏有利，十年国债收益率整体震荡下行。9 月底，随着提振市场的政策陆续出台，权益市场回暖，债券收益率出现显著回调。10 月，股债跷跷板较为显著，随着月初权益市场的回调，以十年国债为代表的债券收益率修复下行至 2.15% 附近，随后窄幅波动。进入 11 月，十年国债收益率阶段性下行，中旬左右受地方债发行预期等因素影响短暂回调，但由于地方债实际一级发行表现好于预期，债券收益率开始较为显著的下行。12 月，随着活期存款自律政策超预期以及资金宽松预期的发酵，十年国债收益率继续下行，报告期末突破 1.70%。信用债方面，各期限信用债收益率呈下行趋势。

###### 2、报告期内本基金投资策略分析

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

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.0346 元；本报告期基金份额净值增长率为 3.27%，业绩比较基准收益率为 4.98%。

#### 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 2025 年，中国经济面临的外部环境不确定性仍然较多，同时内部面临有效需求不足等挑战。经济仍将处于新旧动能转换期，基本面的表现预计仍将延续较为温和的态势，债券市场面临

的基本面方面的压力整体可控。但当前收益率处于较低位置，同时市场对于货币政策进一步宽松保持较高预期，需密切关注制约货币政策的内外部因素变化情况并警惕预期差带来的市场冲击。此外，政府债券的发行大概率扩容加速，需关注供给冲击、基建实物工作量的回升等方面带来的影响。

#### 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

本基金为发起式基金，截止本报告期末，本基金成立未满三年，不适用本项说明。

### § 5 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

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《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

本托管人认真复核了本年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 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     | 安永华明（2025）审字第 70015799_A35 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   | 长盛盛华一年定期开放债券型发起式证券投资基金全体基金份额持有人   |
| 审计意见      | <p>我们审计了长盛盛华一年定期开放债券型发起式证券投资基金的财务报表，包括 2024 年 12 月 31 日和 2023 年 12 月 31 日的资产负债表，2024 年度和 2023 年 12 月 4 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日止期间的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的长盛盛华一年定期开放债券型发起式证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了长盛盛华一年定期开放债券型发起式证券投资基金 2024 年 12 月 31 日和 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度和 2023 年 12 月 4 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。</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。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于长盛盛华一年定期开放债券型发起式证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。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>  |
| 其他信息      | 长盛盛华一年定期开放债券型发起式证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不  |

|                 |  |
|-----------------|--|
|                 | <p>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>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，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>   |
| 管理层和治理层对财务报表的责任 | <p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，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，管理层负责评估长盛盛华一年定期开放债券型发起式证券投资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，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督长盛盛华一年定期开放债券型发起式证券投资基金的财务报告过程。</p>  |
| 注册会计师对财务报表审计的责任 | <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>（1）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>（2）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>（3）评价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>（4）对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，就可能导致对长盛盛华一年定期开放债券型发起式证券投资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</p> |

|           |   |    |
|-----------|---|----|
|           | 盛盛华一年定期开放债券型发起式证券投资基金不能持续经营。<br>(5) 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。<br>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重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 | 安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）  |    |
| 注册会计师的姓名  | 贺耀  | 柳新 |
| 会计师事务所的地址 | 中国 北京   |    |
| 审计报告日期    | 2025 年 3 月 26 日   |    |

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：长盛盛华一年定期开放债券型发起式证券投资基金

报告截止日：2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资 产      | 附注号     | 本期末<br>2024 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 |
|----------|---------|-------------------------|--------------------------|
| 资 产：     |         |                         |                          |
| 货币资金     | 7.4.7.1 | 9,846,867.88            | 792,194.89               |
| 结算备付金    |         | -                       | -                        |
| 存出保证金    |         | 3,144.31                | -                        |
| 交易性金融资产  | 7.4.7.2 | 517,076,450.60          | -                        |
| 其中：股票投资  |         | -                       | -                        |
| 基金投资     |         | -                       | -                        |
| 债券投资     |         | 517,076,450.60          | -                        |
| 资产支持证券投资 |         | -                       | -                        |
| 贵金属投资    |         | -                       | -                        |
| 其他投资     |         | -                       | -                        |
| 衍生金融资产   | 7.4.7.3 | 1,134,050.00            | -                        |
| 买入返售金融资产 | 7.4.7.4 | -                       | 510,263,484.52           |
| 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    |         | -                       | -                        |
| 应收股利     |         | -                       | -                        |
| 应收申购款    |         | -                       | -                        |
| 递延所得税资产  |         | -                       | -                        |



|           |          |                         |                          |
|-----------|----------|-------------------------|--------------------------|
| 其他资产      | 7.4.7.8  | -                       | -                        |
| 资产总计      |          | 528,060,512.79          | 511,055,679.41           |
| 负债和净资产    | 附注号      | 本期末<br>2024 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 |
| 负 债:      |          |                         |                          |
| 短期借款      |          | -                       | -                        |
| 交易性金融负债   |          | -                       | -                        |
| 衍生金融负债    | 7.4.7.3  | -                       | -                        |
| 卖出回购金融资产款 |          | -                       | -                        |
| 应付清算款     |          | -                       | -                        |
| 应付赎回款     |          | -                       | -                        |
| 应付管理人报酬   |          | 133,735.05              | 113,255.99               |
| 应付托管费     |          | 44,578.33               | 37,752.01                |
| 应付销售服务费   |          | -                       | -                        |
| 应付投资顾问费   |          | -                       | -                        |
| 应交税费      |          | 14,397.16               | -                        |
| 应付利润      |          | -                       | -                        |
| 递延所得税负债   |          | -                       | -                        |
| 其他负债      | 7.4.7.9  | 197,575.00              | 2,374.23                 |
| 负债合计      |          | 390,285.54              | 153,382.23               |
| 净资产:      |          |                         |                          |
| 实收基金      | 7.4.7.10 | 510,000,350.14          | 510,000,350.14           |
| 其他综合收益    | 7.4.7.11 | -                       | -                        |
| 未分配利润     | 7.4.7.12 | 17,669,877.11           | 901,947.04               |
| 净资产合计     |          | 527,670,227.25          | 510,902,297.18           |
| 负债和净资产总计  |          | 528,060,512.79          | 511,055,679.41           |

注:1、报告截止日 2024 年 12 月 31 日,基金份额净值为 1.0346 元,基金份额总额为 510,000,350.14 份。于 2023 年 12 月 31 日,基金份额净值为 1.0018 元,基金份额总额为 510,000,350.14 份。

2、本财务报表的实际编制期间为 2024 年度和 2023 年 12 月 4 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日。

7.2 利润表

会计主体:长盛盛华一年定期开放债券型发起式证券投资基金

本报告期:2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位:人民币元

|         |     |   |  |
|---------|-----|---|--|
| 项 目     | 附注号 | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024<br>年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2023 年 12 月 4 日(基金<br>合同生效日)至 2023 年<br>12 月 31 日 |
| 一、营业总收入 |     | 19,137,840.14                             | 1,053,355.04   |
| 1. 利息收入 |     | 1,613,392.61                              | 1,053,355.04   |

|                            |            |               |              |
|----------------------------|------------|---------------|--------------|
| 其中：存款利息收入                  | 7.4.7.13   | 41,414.91     | 12,719.00    |
| 债券利息收入                     |            | -             | -            |
| 资产支持证券利息收入                 |            | -             | -            |
| 买入返售金融资产收入                 |            | 1,571,977.70  | 1,040,636.04 |
| 其他利息收入                     |            | -             | -            |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）          |            | 12,652,179.03 | -            |
| 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   | 13,624,662.14 | -            |
| 资产支持证券投资                   | 7.4.7.16   | -             | -            |
| 收益                         |            |               |              |
| 贵金属投资收益                    | 7.4.7.17   | -             | -            |
| 衍生工具收益                     | 7.4.7.18   | -972,483.11   | -            |
| 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   | 4,872,268.50  | -            |
| 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   | -             | -            |
| <b>减：二、营业总支出</b>           |            | 2,369,910.07  | 151,408.00   |
| 1. 管理人报酬                   | 7.4.10.2.1 | 1,555,417.86  | 113,255.99   |
| 2. 托管费                     | 7.4.10.2.2 | 518,472.68    | 37,752.01    |
| 3. 销售服务费                   |            | -             | -            |
| 4. 投资顾问费                   |            | -             | -            |
| 5. 利息支出                    |            | 47,258.21     | -            |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |            | 47,258.21     | -            |
| 6. 信用减值损失                  | 7.4.7.22   | -             | -            |
| 7. 税金及附加                   |            | 17,603.06     | -            |
| 8. 其他费用                    | 7.4.7.23   | 231,158.26    | 400.00       |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | 16,767,930.07 | 901,947.04   |
| 减：所得税费用                    |            | -             | -            |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | 16,767,930.07 | 901,947.04   |
| <b>五、其他综合收益的税后净额</b>       |            | -             | -            |
| <b>六、综合收益总额</b>            |            | 16,767,930.07 | 901,947.04   |

注：本基金合同于 2023 年 12 月 4 日生效，上年度可比期间自 2023 年 12 月 4 日至 2023 年 12 月

31 日。

7.3 净资产变动表

会计主体：长盛盛华一年定期开放债券型发起式证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目   | 本期   |               |                |
|--|--|---------------|----------------|
|  | 2024 年 1 月 1 日至 2024 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                                    | 510,000,350.14                             | 901,947.04    | 510,902,297.18 |
| 二、本期期初净资产                                    | 510,000,350.14                             | 901,947.04    | 510,902,297.18 |
| 三、本期增减变动额<br>(减少以“-”号填列)                     | -  | 16,767,930.07 | 16,767,930.07  |
| (一)、综合收益总额                                   | -  | 16,767,930.07 | 16,767,930.07  |
| (二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数<br>(净资产减少以“-”号填列)      | -  | -             | -              |
| 其中：1. 基金申购款                                  | -  | -             | -              |
| 2. 基金赎回款                                     | -  | -             | -              |
| (三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动<br>(净资产减少以“-”号填列) | -  | -             | -              |
| 四、本期期末净资产                                    | 510,000,350.14                             | 17,669,877.11 | 527,670,227.25 |
| 项目   | 上年度可比期间                                    |               |                |
|  | 2023 年 12 月 4 日(基金合同生效日)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                                    | -  | -             | -              |
| 二、本期期初净资产                                    | 510,000,350.14                             | -             | 510,000,350.14 |
| 三、本期增减变动额<br>(减少以“-”号填列)                     | -  | 901,947.04    | 901,947.04     |
| (一)、综合收益总额                                   | -  | 901,947.04    | 901,947.04     |

|  |                |            |                |
|--|----------------|------------|----------------|
| （二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数<br>（净资产减少以“-”号填列）  | -              | -          | -              |
| 其中：1. 基金申购款                              | -              | -          | -              |
| 2. 基金赎回款                                 | -              | -          | -              |
| （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                                | 510,000,350.14 | 901,947.04 | 510,902,297.18 |

注：本基金合同于 2023 年 12 月 4 日生效，上年度可比期间自 2023 年 12 月 4 日至 2023 年 12 月 31 日。

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>张壬午</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

长盛盛华一年定期开放债券型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可〔2023〕467 号的注册，由长盛基金管理有限公司于 2023 年 9 月 5 日至 2023 年 12 月 1 日向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验资并出具（2023）验字第 70015799\_A01 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2023 年 12 月 4 日生效。本基金为契约型、定期开放型，存续期限不定。截至 2023 年 12 月 4 日止，长盛盛华一年定开债券发起式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 509,999,000.00 元，折合 509,999,000.00 份长盛盛华一年定开债券发起式基金份额；有效认购款项在募集期间产生的利息为人民币 1,350.14 元，折合 1,350.14 份长盛盛华一年定开债券发起式基金份额；以上收到的实收基金共计人民币 510,000,350.14 元，折合 510,000,350.14 份长盛盛华一年定开债券发起式基金份额。本基金的基金管理人和注册登记机构为长盛基金管理有限公司，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

本基金主要投资于固定收益类金融工具，包括债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、证券公司短期公司债券、政府支持机构债券及政府支持债；可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券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、信用衍生品以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金不直接投资于股票等资产，但可参与可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券的投资。因所持可转换债券转股或可交换债券换股形成的股票，本基金将在其可交易之日起的 10 个交易日内卖出。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：本基金对债券的投资比例不低于基金资产的 80%，应开放期流动性需要，为保护基金份额持有人利益，本基金开放期开始前一个月、开放期以及开放期结束后一个月内，本基金债券资产的投资比例可不受上述限制。开放期内，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%；封闭期内，本基金不受上述 5% 的限制，但每个交易日日终，在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金应当保持不低于交易保证金一倍的现金；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。本基金业绩比较基准为：中债综合指数（全价）收益率。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2024 年 12 月 31 日和

2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度和自 2023 年 12 月 4 日（基金合同生效日）起至 2023 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系 2024 年度和自 2023 年 12 月 4 日（基金合同生效日）起至 2023 年 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

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

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

###### (1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

###### (2) 金融负债分类

除由于金融资产转移不符合终止确认条件或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债以外，本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

##### 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

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，其公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础,对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项,本基金运用简化计量方法,按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产,本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加,如果信用风险自初始确认后未显著增加,处于第一阶段,本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备,并按照账面余额和实际利率计算利息收入;如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的,处于第二阶段,本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备,并按照账面余额和实际利率计算利息收入;如果初始确认后发生信用减值的,处于第三阶段,本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备,并按照摊余成本和实际利率计算利息收入;

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础,通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险,以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况;

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括:通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值,以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息;

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时,该金融资产成为已发生信用减值的金融资产;

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时,本基金直接减记该金融资产的账面余额;

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止,或该收取金融资产现金流量的权利已转移,且符合金融资产转移的终止确认条件的,金融资产将终止确认;

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的,终止确认该金融资产;保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的,不终止确认该金融资产;本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的,分别下列情况处理:放弃了对该金融资产控制的,终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债;未放弃对该金融资产控制的,按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产,并相应确认有关负债。

交易性金融负债(含属于金融负债的衍生工具),按照公允价值进行后续计量,其公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债,采用实际利率法,按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满,则对金融负债进行终止确认。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

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

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

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

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，



同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

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

#### 7.4.4.8 损益平准金

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

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

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或预期收益率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(4) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(5) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(6) 公允价值变动收益系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或

损失；

(7) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致本基金资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时予以确认。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金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所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

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

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

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

### 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

本基金本报告期无会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

### 7.4.6 税项

#### 7.4.6.1 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》的规定，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、

债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额；

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按规定的比例缴纳。

7.4.6.2 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

7.4.6.3 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

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<br>2024 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 |
|----------------|-------------------------|--------------------------|
| 活期存款           | 9,846,867.88            | 792,194.89               |
| 等于：本金          | 9,845,858.65            | 789,723.14               |
| 加：应计利息         | 1,009.23                | 2,471.75                 |
| 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 | 9,846,867.88 | 792,194.89 |
|----|--------------|------------|

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            |       | 本期末<br>2024 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 | 112,159,867.12           | 1,341,146.31 | 114,845,146.31 | 1,344,132.88 |
|               | 银行间市场 | 391,568,142.46           | 7,004,804.29 | 402,231,304.29 | 3,658,357.54 |
|               | 合计    | 503,728,009.58           | 8,345,950.60 | 517,076,450.60 | 5,002,490.42 |
| 资产支持证券        |       | -                        | -            | -              | -            |
| 基金            |       | -                        | -            | -              | -            |
| 其他            |       | -                        | -            | -              | -            |
| 合计            |       | 503,728,009.58           | 8,345,950.60 | 517,076,450.60 | 5,002,490.42 |
| 项目            |       | 上年度末<br>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 | -                        | -            | -              | -            |
|               | 银行间市场 | -                        | -            | -              | -            |
|               | 合计    | -                        | -            | -              | -            |
| 资产支持证券        |       | -                        | -            | -              | -            |
| 基金            |       | -                        | -            | -              | -            |
| 其他            |       | -                        | -            | -              | -            |
| 合计            |       | -                        | -            | -              | -            |

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

| 项目     | 本期末<br>2024 年 12 月 31 日 |      |    |    |
|--------|-------------------------|------|----|----|
|        | 合同/名义<br>金额             | 公允价值 |    | 备注 |
|        |                         | 资产   | 负债 |    |
| 利率衍生工具 | -                       | -    | -  | -  |

|        |                          |              |    |    |
|--------|--------------------------|--------------|----|----|
| 货币衍生工具 | -                        | -            | -  | -  |
| 权益衍生工具 | -                        | -            | -  | -  |
| 其他衍生工具 | -                        | 1,134,050.00 | -  | -  |
| 合计     | -                        | 1,134,050.00 | -  | -  |
| 项目     | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 |              |    |    |
|        | 合同/名义<br>金额              | 公允价值         |    | 备注 |
|        |                          | 资产           | 负债 |    |
| 利率衍生工具 | -                        | -            | -  | -  |
| 货币衍生工具 | -                        | -            | -  | -  |
| 权益衍生工具 | -                        | -            | -  | -  |
| 其他衍生工具 | -                        | -            | -  | -  |
| 合计     | -                        | -            | -  | -  |

注：其他衍生工具投资为信用风险缓释凭证。

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

单位：人民币元

|       |                          |           |
|-------|--------------------------|-----------|
| 项目    | 本期末<br>2024 年 12 月 31 日  |           |
|       | 账面余额                     | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | -                        | -         |
| 银行间市场 | -                        | -         |
| 合计    | -                        | -         |
| 项目    | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 |           |
|       | 账面余额                     | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | 244,197,594.72           | -         |
| 银行间市场 | 266,065,889.80           | -         |
| 合计    | 510,263,484.52           | -         |

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<br>2024 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 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      | 575.00                  | 2,374.23                 |
| 其中：交易所市场    | -                       | -                        |
| 银行间市场       | 575.00                  | 2,374.23                 |
| 应付利息        | -                       | -                        |
| 预提费用        | 197,000.00              | -                        |
| 合计          | 197,575.00              | 2,374.23                 |

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日 |                |
|---------------|--|----------------|
|               | 基金份额（份）                                | 账面金额           |
| 上年度末          | 510,000,350.14                         | 510,000,350.14 |
| 本期申购          | -                                      | -              |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -                                      | -              |
| 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           | 510,000,350.14                         | 510,000,350.14 |

注：若本基金有分红及转换业务，申购含红利再投、转换入；赎回含转换出。

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

| 项目   | 已实现部分      | 未实现部分 | 未分配利润合计    |
|------|------------|-------|------------|
| 上年度末 | 901,947.04 | -     | 901,947.04 |

|                |               |              |               |
|----------------|---------------|--------------|---------------|
| 本期期初           | 901,947.04    | -            | 901,947.04    |
| 本期利润           | 11,895,661.57 | 4,872,268.50 | 16,767,930.07 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -             | -            | -             |
| 其中：基金申购款       | -             | -            | -             |
| 基金赎回款          | -             | -            | -             |
| 本期已分配利润        | -             | -            | -             |
| 本期末            | 12,797,608.61 | 4,872,268.50 | 17,669,877.11 |

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2024年1月1日至2024年12月31日 | 上年度可比期间<br>2023年12月4日（基金合同生效日）至2023年12月31日 |
|-----------|-----------------------------|--|
| 活期存款利息收入  | 20,107.81                   | 12,719.00                                  |
| 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 | 21,258.55                   | -  |
| 其他        | 48.55                       | -  |
| 合计        | 41,414.91                   | 12,719.00                                  |

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<br>2024年1月1日至2024年12月31日 | 上年度可比期间<br>2023年12月4日（基金合同生效日）至2023年12月31日 |
|------------------------------|-----------------------------|--|
| 债券投资收益——利息收入                 | 13,662,306.61               | -  |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | -37,644.47                  | -  |
| 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                           | 13,624,662.14               | -  |



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<br>2024年1月1日至2024年12月31日 | 上年度可比期间<br>2023年12月4日（基金合同生效日）至2023年12月31日 |
|------------------------|-----------------------------|--|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 611,381,282.51              | -  |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 602,597,311.30              | -  |
| 减：应计利息总额               | 8,808,578.18                | -  |
| 减：交易费用                 | 13,037.50                   | -  |
| 买卖债券差价收入               | -37,644.47                  | -  |

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

无。

7.4.7.17 贵金属投资收益

无。

7.4.7.18 衍生工具收益

7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

| 项目       | 本期<br>2024年1月1日至2024年12月31日 | 上年度可比期间<br>2023年12月4日（基金合同生效日）至2023年12月31日 |
|----------|-----------------------------|--|
| 信用风险缓释凭证 | -972,483.11                 | -  |

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<br>2024年1月1日至2024年12月31日 | 上年度可比期间<br>2023年12月4日（基金合同生效日）至2023年12月31日 |
|------------|-----------------------------|--|
| 1. 交易性金融资产 | 5,002,490.42                | -  |
| 股票投资       | -                           | -  |
| 债券投资       | 5,002,490.42                | -  |
| 资产支持证券投资   | -                           | -  |

|                        |                 |   |
|------------------------|-----------------|---|
| 基金投资                   | -               | - |
| 贵金属投资                  | -               | - |
| 其他                     | -               | - |
| 2. 衍生工具                | -130, 221. 92   | - |
| 权证投资                   | -               | - |
| 信用风险缓释凭证               | -130, 221. 92   | - |
| 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                     | 4, 872, 268. 50 | - |

7.4.7.21 其他收入

无。

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<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2023 年 12 月 4 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日 |
|---------|--|---|
| 审计费用    | 68, 000. 00                            | -   |
| 信息披露费   | 120, 000. 00                           | -   |
| 证券出借违约金 | -                                      | -   |
| 银行费用    | 7, 858. 26                             | -   |
| 账户维护费   | 34, 500. 00                            | -   |
| 开户费     | -                                      | 400. 00   |
| 其他      | 800. 00                                | -   |
| 合计      | 231, 158. 26                           | 400. 00   |

7.4.7.24 分部报告

无。

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

截至财务报表批准日，本基金无需要说明的重大资产负债表日后事项。

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 |

|                      |              |
|----------------------|--------------|
| 兴业银行股份有限公司（“兴业银行”）   | 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     |
| 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（“长盛创富”） | 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  |

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<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2023 年 12 月 4 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日 |
|------------------|--|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费   | 1,555,417.86                           | 113,255.99  |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 457,475.35                             | 33,310.51   |
| 应支付基金管理人的净管理费    | 1,097,942.51                           | 79,945.48   |

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<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2023 年 12 月 4 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日 |
|----------------|--|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 518,472.68                             | 37,752.01   |

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

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

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固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

| 项目                                 | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月<br>31 日 | 上年度可比期间<br>2023 年 12 月 4 日（基金合<br>同生效日）至 2023 年 12 月<br>31 日 |
|------------------------------------|---|--|
| 基金合同生效日（2023 年 12 月<br>4 日）持有的基金份额 | -   | 10,001,350.14  |
| 报告期初持有的基金份额                        | 10,001,350.14                             | -  |
| 报告期间申购/买入总份额                       | -   | -  |
| 报告期间因拆分变动份额                        | -   | -  |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额                     | -   | -  |
| 报告期末持有的基金份额                        | 10,001,350.14                             | 10,001,350.14  |
| 报告期末持有的基金份额<br>占基金总份额比例            | 1.9610%                                   | 1.9610%  |

注：基金管理人持有本基金基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付。

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

| 关联方名称 | 本期末<br>2024 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 |
|-------|-------------------------|--------------------------|
|-------|-------------------------|--------------------------|

|      | 持有的<br>基金份额    | 持有的基金份额<br>占基金总份额的<br>比例（%） | 持有的<br>基金份额    | 持有的基金份额<br>占基金总份额的比<br>例（%） |
|------|----------------|-----------------------------|----------------|-----------------------------|
| 兴业银行 | 499,999,000.00 | 98.0390                     | 499,999,000.00 | 98.0390                     |

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。

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<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月<br>31 日 |           | 上年度可比期间<br>2023年12月4日（基金合同生效日）至2023<br>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    |
| 兴业银行  | 9,846,867.88                              | 20,107.81 | 792,194.89                                     | 12,719.00 |
| 合计    | 9,846,867.88                              | 20,107.81 | 792,194.89                                     | 12,719.00 |

注：本基金的银行存款由基金托管人兴业银行保管，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（2024 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；监察稽核部和风险管理部负责监察公司风险管理措施的执行；各职能部门在一定范围内负责本部门的风险评估和监控。

本基金在日常经营活动中面临的風險主要包括信用風險、流动性風險及市場風險。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上風險控制在限定的范围之内，使本基金在風險和收益之间取得最佳的平衡以实现“風險和收益相匹配”的風險收益目标。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測各种風險产生的可能損失。从定性分析的角度出发，判断風險損失的严重程度和出现同类風險損失的頻度。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風險量化指标、模型，日常的量化报告，确定風險損失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种風險进行监督、检查和评估，并通过相应决策，將風險控制在可承受的范围內。

7.4.13.2 信用風險

信用風險是指基金在交易过程中因交易对手未履行合約責任，或者基金所投资證券之發行人出現違約、拒絕支付到期本息，導致基金資產損失和收益變化的風險。本基金的基金管理人 在交易前對交易对手的資信狀況進行了充分的評估，通過對投資品種信用等級評估來控制證券發行人的信用風險，且通過分散化投資以分散信用風險。本基金投資於一家公司發行的證券市值不超過基金資產淨值的 10%，且本基金與由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的證券，不得超過該證券的 10%。

本基金在交易所進行的交易均與中國證券登記結算有限責任公司完成證券交收和款項清算，因此違約風險發生的可能性很小；基金在進行銀行間同業市場交易前均對交易對手進行信用評估，以控制相應的信用風險。

7.4.13.2.1 按短期信用評級列示的債券投資

單位：人民幣元

| 短期信用評級 | 本期末<br>2024 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|--------------------------|
| A-1    | -                       | -                        |
| A-1 以下 | -                       | -                        |

|     |               |   |
|-----|---------------|---|
| 未评级 | 31,024,122.74 | — |
| 合计  | 31,024,122.74 | — |

注：上述评级均取自第三方评级机构。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2024 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|--------------------------|
| A-1    | —                       | —                        |
| A-1 以下 | —                       | —                        |
| 未评级    | 49,548,452.05           | —                        |
| 合计     | 49,548,452.05           | —                        |

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<br>2024 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|--------------------------|
| AAA    | 217,639,692.06          | —                        |
| AAA 以下 | 56,729,099.93           | —                        |
| 未评级    | 162,135,083.82          | —                        |
| 合计     | 436,503,875.81          | —                        |

注：上述评级均取自第三方评级机构。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

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所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面主要来自于基金份额持有人于约定开放日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。

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严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控流动性受限资产比例、流动性资产比例及

压力测试等方式防范流动性风险，并对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市或在银行间同业市场交易，因此，除在附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，本基金所持大部分资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注 7.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

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

利率风险是指基金的公允价值和未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2024 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                    | 9,845,858.65   | -              | -     | 1,009.23     | 9,846,867.88   |
| 存出保证金                   | 3,142.91       | -              | -     | 1.40         | 3,144.31       |
| 交易性金融资产                 | 149,524,000.00 | 359,206,500.00 | -     | 8,345,950.60 | 517,076,450.60 |
| 衍生金融资产                  | -              | -              | -     | 1,134,050.00 | 1,134,050.00   |
| 资产总计                    | 159,373,001.56 | 359,206,500.00 | -     | 9,481,011.23 | 528,060,512.79 |
| 负债                      |                |                |       |              |                |
| 应付管理人报酬                 | -              | -              | -     | 133,735.05   | 133,735.05     |
| 应付托管费                   | -              | -              | -     | 44,578.33    | 44,578.33      |



|                          |                |                |       |              |                |
|--------------------------|----------------|----------------|-------|--------------|----------------|
| 应交税费                     | -              | -              | -     | 14,397.16    | 14,397.16      |
| 其他负债                     | -              | -              | -     | 197,575.00   | 197,575.00     |
| 负债总计                     | -              | -              | -     | 390,285.54   | 390,285.54     |
| 利率敏感度缺口                  | 159,373,001.56 | 359,206,500.00 | -     | 9,090,725.69 | 527,670,227.25 |
| 上年度末<br>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                     | 789,723.14     | -              | -     | 2,471.75     | 792,194.89     |
| 买入返售金融资产                 | 509,801,998.70 | -              | -     | 461,485.82   | 510,263,484.52 |
| 资产总计                     | 510,591,721.84 | -              | -     | 463,957.57   | 511,055,679.41 |
| 负债                       |                |                |       |              |                |
| 应付管理人报酬                  | -              | -              | -     | 113,255.99   | 113,255.99     |
| 应付托管费                    | -              | -              | -     | 37,752.01    | 37,752.01      |
| 其他负债                     | -              | -              | -     | 2,374.23     | 2,374.23       |
| 负债总计                     | -              | -              | -     | 153,382.23   | 153,382.23     |
| 利率敏感度缺口                  | 510,591,721.84 | -              | -     | 310,575.34   | 510,902,297.18 |

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

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（2024 年 12 月 31 日）       | 上年度末（2023 年 12 月 31 日） |
|    | 1. 市场利率下降 25 个基点   | 2,521,406.22                | -                      |
|    | 2. 市场利率上升 25 个基点   | -2,521,406.22               | -                      |

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均以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金投资于固定收益类品种，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对本基金资产净值无重大影响。

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<br>2024 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 |
|---------------|-------------------------|--------------------------|
| 第一层次          | -                       | -                        |
| 第二层次          | 518,210,500.60          | -                        |
| 第三层次          | -                       | -                        |
| 合计            | 518,210,500.60          | -                        |

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

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

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

7.4.15.2 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。

7.4.15.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2025 年 3 月 26 日经本基金的基金管理人批准。

§ 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            | 517,076,450.60 | 97.92        |
|    | 其中：债券             | 517,076,450.60 | 97.92        |
|    | 资产支持证券            | -              | -            |
| 4  | 贵金属投资             | -              | -            |
| 5  | 金融衍生品投资           | 1,134,050.00   | 0.21         |
| 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      | 9,846,867.88   | 1.86         |
| 8  | 其他各项资产            | 3,144.31       | 0.00         |
| 9  | 合计                | 528,060,512.79 | 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      | 10,424,589.04  | 1.98         |
| 2  | 央行票据      | —              | —            |
| 3  | 金融债券      | 354,164,347.11 | 67.12        |
|    | 其中：政策性金融债 | 136,524,655.05 | 25.87        |
| 4  | 企业债券      | —              | —            |
| 5  | 企业短期融资券   | 31,024,122.74  | 5.88         |
| 6  | 中期票据      | 71,914,939.66  | 13.63        |
| 7  | 可转债（可交换债） | —              | —            |
| 8  | 同业存单      | 49,548,452.05  | 9.39         |
| 9  | 其他        | —              | —            |
| 10 | 合计        | 517,076,450.60 | 97.99        |

### 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  | 200203    | 20 国开 03                  | 500,000 | 51,610,286.89 | 9.78         |
| 2  | 112483309 | 24 南京银行<br>CD186          | 500,000 | 49,548,452.05 | 9.39         |
| 3  | 230208    | 23 国开 08                  | 400,000 | 42,058,323.29 | 7.97         |
| 4  | 230203    | 23 国开 03                  | 300,000 | 31,972,622.95 | 6.06         |
| 5  | 102483838 | 24 恒逸<br>MTN002(科创<br>票据) | 300,000 | 30,524,301.37 | 5.78         |

### 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

20 国开 03、23 国开 08、23 国开 03：

2024 年 12 月 27 日，京金罚决字（2024）43 号显示，国家开发银行存在贷款支付管理不到位、向未取得行政许可的项目发放贷款等违法违规事实，被处罚款 60 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。

24 海通 04：

2024 年 1 月 5 日，深交所决定对海通证券采取书面警示的自律监管措施，原因是海通证券在担任江苏沃得农业机械股份有限公司首次公开发行股票并在创业板上市项目保荐人过程中，存在多项违规行为。2024 年 1 月 29 日，海通证券因首发保荐业务履职尽责明显不到位、投行质控内核部门未识别项目重大风险及对尽职调查把关不审慎等缺陷，上交所决定采取以下监管措施：对海通证券予以监管谈话，对公司相关责任人予以监管警示。2024 年 4 月 12 日，海通证券因未依法履行职责，公司自身被中国证券监督管理委员会立案调查。2024 年 4 月 19 日，海通证券因涉及中核钛白实际控制人王泽龙涉嫌违反限制性规定转让股票事件，被中国证监会责令改正，给予警告，没收违法所得 78.94 万元，罚款 697.50 万元，合计 776.44 万元。2024 年 4 月 30 日，海通证券作为“21 格地 02”、“22 格地 02”的主承销商和受托管理人，收到中国证券监督管理委员会广东监管局行政监管措施决定书。2024 年 5 月 31 日，海通证券因内控制度不完善，公司自身被中国证券监督管理委员会处以责令改正。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。

24 申证 02：

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

22 广发 05：

2024 年 3 月 22 日，广发证券因内控制度不完善，公司自身被上海证券交易所处以警示。本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合法律法规、基金合同和公司投资制度的规定。

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

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 | 3,144.31 |
| 2  | 应收清算款 | -        |
| 3  | 应收股利  | -        |
| 4  | 应收利息  | -        |
| 5  | 应收申购款 | -        |
| 6  | 其他应收款 | -        |
| 7  | 待摊费用  | -        |
| 8  | 其他    | -        |
| 9  | 合计    | 3,144.31 |

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

| 持有人户数<br>(户) | 户均持有的基金<br>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<br>例 (%) | 持有份额  | 占总份额比<br>例 (%) |
| 2            | 255,000,175.07 | 510,000,350.14 | 100.00         | 0.00  | 0.00           |

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 持有份额总数 (份) | 占基金总份额比例 (%) |
|------------------|------------|--------------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 0.00       | 0.0000       |

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                                 | 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<br>究部门负责人持有本开放式基金 | 0                 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                    | 0                 |

9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

| 项目              | 持有份额总数        | 持有份额占基金总<br>份额比例<br>(%) | 发起份额总数        | 发起份额占<br>基金总份额<br>比例(%) | 发起份额承<br>诺持有期限          |
|-----------------|---------------|-------------------------|---------------|-------------------------|-------------------------|
| 基金管理人固有资<br>金   | 10,001,350.14 | 1.96                    | 10,001,350.14 | 1.96                    | 自基金合同<br>生效之日起<br>不少于三年 |
| 基金管理人高级管<br>理人员 | -             | -                       | -             | -                       | -                       |
| 基金经理等人员         | -             | -                       | -             | -                       | -                       |
| 基金管理人股东         | -             | -                       | -             | -                       | -                       |
| 其他              | -             | -                       | -             | -                       | -                       |
| 合计              | 10,001,350.14 | 1.96                    | 10,001,350.14 | 1.96                    | -                       |

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

|                                    |                |
|------------------------------------|----------------|
| 基金合同生效日（2023 年 12 月 4 日）<br>基金份额总额 | 510,000,350.14 |
| 本报告期期初基金份额总额                       | 510,000,350.14 |
| 本报告期基金总申购份额                        | -              |
| 减：本报告期基金总赎回份额                      | -              |
| 本报告期基金拆分变动份额                       | -              |
| 本报告期期末基金份额总额                       | 510,000,350.14 |

§ 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 |
| 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。 |

11.2.2 基金经理的变动情况

本报告期本基金基金经理未发生变动。

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

报告期内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安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），本报告期内本基金未更换会计师事务所，本报告期应支付给该会计师事务所的报酬为 68,000.00 元，已连续为本基金提供审计服务 1 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

本报告期内，管理人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，本基金托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中无受稽查或处罚等情况。

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(%) |    |
| 中信证券 | 3      | -    | -               | -         | -             | -  |

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 | 成交金额   | 占当期债券回购成交 | 成交金额 | 占当期权证成交总 |



|      |                | 的比例<br>(%) |                | 总额的<br>比例 (%) |   | 额的比例<br>例 (%) |
|------|----------------|------------|----------------|---------------|---|---------------|
| 中信证券 | 125,953,710.00 | 100.00     | 487,600,000.00 | 100.00        | - | -             |

注：1、交易单元的选择标准：

- （1）具备监管机构规定的相关资质、财务状况良好、经营行为规范、合规风控能力较强。
- （2）具有较强的研究服务能力、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。
- （3）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合证券交易的需要。

2、交易单元的选择程序：

- （1）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协议。

3、本报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：无。

4、本部分的数据统计时间区间与本报告的报告期一致，统计范围仅包括本基金；本公司网站披露的《长盛基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况公告（2024 年度）》的报告期为 2024 年 7 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日，报告的主要内容为报告期间本公司旗下存续过的所有公募基金通过租用证券公司交易单元和委托证券公司进行证券投资及佣金支付情况，包括报告期间成立、清算、转型（如有）的公募基金。敬请投资者关注上述报告的统计口径差异。

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  | 长盛基金管理有限公司关于旗下部分基金增加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 | 2024 年 3 月 1 日  |
| 2  | 长盛基金管理有限公司旗下基金 2024 年 1 季度报告提示性公告     | 中国证监会指定披露媒介 | 2024 年 4 月 20 日 |
| 3  | 长盛盛华一年定期开放债券型发起式证券投资基金 2024 年第 1 季度报告 | 中国证监会指定披露媒介 | 2024 年 4 月 20 日 |
| 4  | 长盛盛华一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金产品资料概要更新      | 中国证监会指定披露媒介 | 2024 年 6 月 25 日 |
| 5  | 长盛盛华一年定期开放债券型发起式证券投资基金 2024 年第 2 季度报告 | 中国证监会指定披露媒介 | 2024 年 7 月 19 日 |
| 6  | 长盛基金管理有限公司旗下基金 2024 年 2 季度报告提示性公告     | 中国证监会指定披露媒介 | 2024 年 7 月 19 日 |
| 7  | 长盛盛华一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金产品资料概要更新      | 中国证监会指定披露媒介 | 2024 年 8 月 26 日 |

|    |   |             |                  |
|----|---|-------------|------------------|
| 8  | 长盛盛华一年定期开放债券型发起式证券投资基金 2024 年中期报告                 | 中国证监会指定披露媒介 | 2024 年 8 月 30 日  |
| 9  | 长盛基金管理有限公司旗下基金 2024 年中期报告提示性公告                    | 中国证监会指定披露媒介 | 2024 年 8 月 30 日  |
| 10 | 长盛基金管理有限公司旗下基金 2024 年第 3 季度报告提示性公告                | 中国证监会指定披露媒介 | 2024 年 10 月 25 日 |
| 11 | 长盛盛华一年定期开放债券型发起式证券投资基金 2024 年第 3 季度报告             | 中国证监会指定披露媒介 | 2024 年 10 月 25 日 |
| 12 | 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销售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 | 2024 年 11 月 15 日 |
| 13 | 长盛盛华一年定期开放债券型发起式证券投资基金开放日常申购（赎回、转换）业务公告           | 中国证监会指定披露媒介 | 2024 年 11 月 28 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              | 20240101~20241231        | 499,999,000.00 | 0.00 | 0.00 | 499,999,000.00 | 98.04   |
| 产品特有风险   |                |                          |                |      |      |                |         |
| 本基金本报告期存在单一投资者持有基金份额比例超过 20%的情况，当该基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致的风险包括：巨额赎回风险、流动性风险、基金资产净值持续低于 5000 万元的风险、基金份额净值大幅波动风险以及基金收益水平波动风险。本基金管理人将对申购赎回进行审慎的应对，保护中小投资者利益。 |                |                          |                |      |      |                |         |

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

- 5、法律意见书；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照。

### 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

2025 年 3 月 29 日