

长盛利鑫 90 天持有期纯债债券型证券投资基金

2025 年中期报告

2025 年 6 月 30 日

基金管理人：长盛基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

送出日期：2025 年 8 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 08 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2025 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	35
7.1 期末基金资产组合情况	35
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	36
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	36
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	36
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	36

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	37
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	37
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	37
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	37
7.11 投资组合报告附注	37
§ 8 基金份额持有人信息	38
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	38
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	38
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	38
§ 9 开放式基金份额变动	39
§ 10 重大事件揭示	39
10.1 基金份额持有人大会决议	39
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	39
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	39
10.4 基金投资策略的改变	40
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	40
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	40
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	40
10.8 其他重大事件	40
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	42
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	42
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	42
§ 12 备查文件目录	42
12.1 备查文件目录	42
12.2 存放地点	42
12.3 查阅方式	42

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长盛利鑫 90 天持有期纯债债券型证券投资基金	
基金简称	长盛利鑫 90 天持有纯债	
基金主代码	020687	
基金运作方式	契约型开放式，但本基金对每份基金份额设置 90 天的最短持有期限	
基金合同生效日	2024 年 6 月 12 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	48,515,979.65 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	长盛利鑫 90 天持有纯债 A	长盛利鑫 90 天持有纯债 C
下属分级基金的交易代码	020687	020688
报告期末下属分级基金的份 额总额	41,026,753.87 份	7,489,225.78 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险和保持较高流动性的基础上，力求获得超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	（一）大类资产配置 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。 （二）债券组合管理策略 1、利率策略：利率策略主要是从组合久期及组合期限结构两个方向制定针对市场利率因素的投资策略。 2、类属配置策略：债券类属策略主要是通过研究国民经济运行状况，货币市场及资本市场资金供求关系，以及不同时期市场投资热点，分析国债、金融债、企业债、公司债等不同债券种类的利差水平，评定不同债券类属的相对投资价值，确定组合资产在不同债券类属之间配置比例。 3、信用策略：信用品种的选择采取以利率研究和发行人偿债能力研究为核心的分析方式，在对宏观经济、利率走势、发行人经营及财务状况进行分析的基础上，结合信用品种的发行条款，建立信用债备选库，并以此为基础拟定信用品种的投资方法。 4、相对价值策略：本基金认为市场存在着失效的现象，短期因素的影响被过分夸大。债券市场的参与者众多，投资行为、风险偏好、财务与税收处理等各不相同，发掘存在于这些不同因素之间的相对价值，也是本基金发现投资机会的重要方面。 5、债券选择策略：根据单个债券到期收益率相对于市场收益率曲线的偏离程度，结合其信用等级、流动性、选择权条款、税赋特点等

	因素，确定其投资价值，选择那些定价合理或价值被低估的债券进行投资。 （三）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。基金管理人将充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征，运用国债期货对冲系统风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。
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	交通银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	张利宁	方圆
	联系电话	010-86497608	95559
	电子邮箱	zhangln@csfunds.com.cn	fangy_20@bankcomm.com
客户服务电话		400-888-2666、010-86497888	95559
传真		010-86497999	021-62701216
注册地址		深圳市福田区中心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	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.csfunds.com.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人和基金托管人的办公地址

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2025 年 1 月 1 日-2025 年 6 月 30 日)	
	长盛利鑫 90 天持有纯债 A	长盛利鑫 90 天持有纯债 C
本期已实现收益	131,687.28	66,539.71
本期利润	122,930.12	-10,547.77
加权平均基金份额本期利润	0.0055	-0.0005
本期加权平均净值利润率	0.53%	-0.05%
本期基金份额净值增长率	0.57%	0.48%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	679,707.40	106,935.34
期末可供分配基金份额利润	0.0166	0.0143
期末基金资产净值	42,352,232.39	7,721,776.90
期末基金份额净值	1.0323	1.0311
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	3.23%	3.11%

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。表中的“期末”均指本报告期最后一日，即 6 月 30 日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

长盛利鑫 90 天持有纯债 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	0.26%	0.02%	0.31%	0.04%	-0.05%	-0.02%
过去三个月	0.74%	0.05%	1.06%	0.10%	-0.32%	-0.05%
过去六个月	0.57%	0.06%	-0.14%	0.11%	0.71%	-0.05%
过去一年	3.15%	0.08%	2.36%	0.10%	0.79%	-0.02%

自基金合同生效起 至今	3.23%	0.08%	2.77%	0.10%	0.46%	-0.02%
----------------	-------	-------	-------	-------	-------	--------

长盛利鑫 90 天持有纯债 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.25%	0.02%	0.31%	0.04%	-0.06%	-0.02%
过去三个月	0.69%	0.05%	1.06%	0.10%	-0.37%	-0.05%
过去六个月	0.48%	0.06%	-0.14%	0.11%	0.62%	-0.05%
过去一年	3.04%	0.08%	2.36%	0.10%	0.68%	-0.02%
自基金合同生效起 至今	3.11%	0.08%	2.77%	0.10%	0.34%	-0.02%

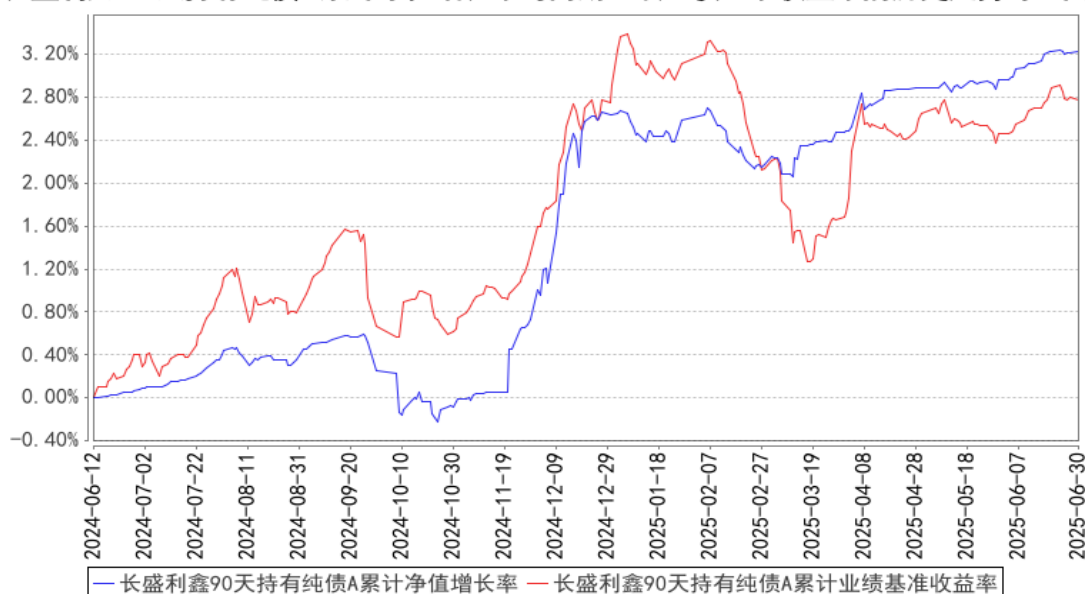
注：本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程：

本基金业绩比较基准为：中债综合指数（全价）收益率

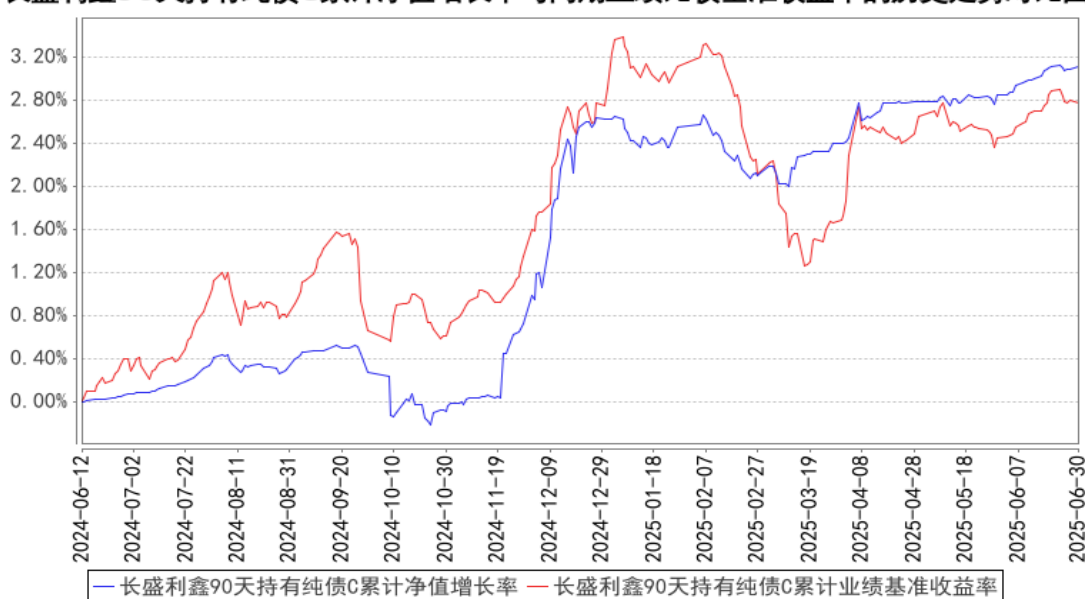
中债综合指数（全价）由中央国债登记结算有限责任公司编制并发布，该指数样本具有广泛的市场代表性，涵盖了主要交易市场（银行间市场、交易所市场等）、不同发行主体（政府、企业等）和期限（长期、中期、短期等）。鉴于中债综合指数(全价)能够反映债券全市场的整体价格和投资回报情况，所以以其收益率作为本基金的业绩比较基准。比较基准每个交易日进行一次再平衡，每个交易日在加入损益后根据设定的权重比例进行大类资产之间的再平衡，使大类资产比例保持恒定。

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

长盛利鑫90天持有纯债A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



长盛利鑫90天持有纯债C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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

§ 4 管理人报告

4.1 基金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 2025 年 6 月 30 日，基金管理人共管理七十三只开放式基金，并管理多个全国社保基金组合和私募资产管理计划。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的 基金经理 （助理）期 限		证券 从业 年限	说明
		任职 日期	离任 日期		
张建	本基金基金经理，长盛安鑫中短债债券型证券投资基金基金经理，长盛恒盛利率债债券型证券投资基金基金经理，长盛盛远债券型证券投资基金基金经理，长盛盛康纯债债券型证券投资基金基金经理，长盛悦鑫 60 天持有期纯债债券型证券投资基金基金经理，长盛嘉鑫 30 天持有期纯债债券型证券投资基金基金经理，长盛盛悦债券型证券投资基金基金经理，长盛元赢四个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。	2024 年 6 月 12 日	-	12 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。

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《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本基金本报告期内无基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施准则、本基金基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行《公司公平交易细则》各项规定，在研究、投资授权与决策、交易执行等各个环节，公平对待旗下所有投资组合，包括公募基金、社保组合、私募资产管理计划等。具体如下：

研究支持，公司旗下所有投资组合共享公司研究部门研究成果，所有投资组合经理在公司研究平台上拥有同等权限。

投资授权与决策，公司实行投资决策委员会领导下的投资组合经理负责制，各投资组合经理在投资决策委员会的授权范围内，独立完成投资组合的管理工作。各投资组合经理遵守投资信息隔离墙制度。

交易执行，公司实行集中交易制度，所有投资组合的投资指令均由交易部统一执行委托交易。交易部依照《公司公平交易细则》的规定，场内交易，强制开启恒生交易系统公平交易程序；场外交易，严格遵守相关工作流程，保证交易执行的公平性。

投资管理行为的监控与分析评估，公司风险管理部、监察稽核部，依照《公司公平交易细则》的规定，持续、动态监督公司投资管理全过程，并进行分析评估，及时向公司管理层报告发现问题，保障公司旗下所有投资组合均被公平对待。

公司对过去 4 个季度的同向交易行为进行数量分析，计算溢价率、贡献率、占优比等指标，使用双边 90%置信水平对 1 日、3 日、5 日的交易片段进行 T 检验，未发现违反公平交易及利益输送的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，未发现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

1、报告期内行情回顾

上半年，经济基本面承压，财政、货币及产业政策相配合，稳增长政策效果持续显现，在消费品以旧换新和设备更新补贴作用下，消费增长较好，1-6 月份社零累计同比增长 5%，好于去年同期。投资方面，房地产投资延续下滑趋势，对经济增长形成拖累，基建投资发力，1-6 月份基建投资累计同比增长 8.9%，制造业投资增速边际下滑，1-6 月份累计同比增长 7.5%。受关税冲击，进出口走弱。6 月，CPI 当月同比上涨 0.1%，PPI 当月同比下降 3.6%，物价承压。

政策层面，在“适度宽松”的政策基调下，央行坚持支持性货币政策立场，结合经济运行情况和市场情况，灵活开展货币投放。一季度，稳增长预期较强，货币环境收紧，资金价格抬升，进而带动债券市场调整。为对冲外部冲击，央行在二季度进行降准、降息操作，释放长期流动性，引导资金利率下行，降低企业融资成本，并通过 MLF、OMO 等传统工具，平抑资金面波动。二季度，资金面改善明显，资金价格中枢下移，价格稳定性提升，为低利率环境下债券市场稳定运行创造条件。

市场层面，一季度，资金面趋紧，资金价格中枢抬升，债券市场承压，调整明显。二季度，资金面紧张程度转缓，外部环境不确定性增加，内需边际走弱，政策呵护明显，债市走强。

在此背景下，上半年，债券市场呈现震荡行情，收益率先上后下，整体变动不大。以 AA+中短期票据为例，1 年期收益率下行 0.5BP 至 1.7736%，3 年期收益率下行 1.02BP 至 1.9039%，5 年期收益率下行 3.18BP 至 2.0144%。

2、报告期内本基金投资策略分析

报告期内，本基金主要投资于流动性较好的中短期债券，在防范信用风险的前提下根据市场情况不断调整资产结构。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末长盛利鑫 90 天持有纯债 A 的基金份额净值为 1.0323 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.57%，同期业绩比较基准收益率为-0.14%；截至本报告期末长盛利鑫 90 天持有纯债 C 的基金份额净值为 1.0311 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.48%，同期业绩比较基准收益率为-0.14%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，受中美关税扰动和高基数影响，出口增长承压。内需偏弱，餐饮消费下滑。房地产投资下行，制造业投资增速边际趋缓，基建投资增速提升，但在化债背景下，扩张边际受限，

整体对经济增长支撑有限。

下半年，债券市场仍处于低利率环境，关税谈判进程、反内卷等或对债券市场带来扰动。在经济基本面承压的背景下，货币环境大概率维持宽松，“适度宽松”的货币政策有望进一步落地。预计下半年债市或面临一定的扰动，但整体较为有利，大幅调整的风险不大。宽松的货币政策进一步落地前，无风险利率下行空间受限，信用利差和期限利差仍有压缩空间。

在此背景下，结合本基金的定位，我们将继续坚持绝对收益策略，追求收益的确定性，灵活调整组合久期，视市场情况积极把握中长端活跃券波段交易的机会，在保障组合资产安全和流动性充裕的前提下，努力为投资人创造长期稳健的投资收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照《企业会计准则》、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持投资品种进行估值。

本基金管理人设有估值工作小组，负责制定、评估、复核和修订基金估值程序和技术，适时更新估值相关制度，指导并监督各类投资品种的估值程序，评估会计政策变更的影响，对证券投资基金估值方法进行最终决策等。估值工作小组由总经理担任组长，督察长担任副组长，小组成员均具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备投资、研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

参与估值流程的各方还包括本基金托管人和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任，当存有异议时，托管人有责任要求基金管理公司作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已分别与中债金融估值中心有限公司和中证指数有限公司签署服务协议，由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据和流通受限股票的折扣率数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金未实施利润分配，符合法律法规和基金合同的相关约定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金自 2025 年 2 月 25 日至 2025 年 5 月 7 日期间出现连续 20 个工作日基金资产净值低于 5000 万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，基金托管人在长盛利鑫 90 天持有期纯债债券型证券投资基金的托管过程中，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

本报告期内，长盛基金管理有限公司在长盛利鑫 90 天持有期纯债债券型证券投资基金投资运作、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、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本报告期内，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长盛利鑫 90 天持有期纯债债券型证券投资基金的中期报告中财务指标、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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：长盛利鑫 90 天持有期纯债债券型证券投资基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	689,940.80	8,991,871.57
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	52,455,661.90	46,980,947.12
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		52,455,661.90	46,980,947.12
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-

其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	101,537.95
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		53,145,602.70	56,074,356.64
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		3,000,669.94	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		12,410.21	10,020.63
应付托管费		2,068.37	1,670.10
应付销售服务费		1,315.95	4,889.72
应付投资顾问费		-	-
应交税费		1,676.52	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	53,452.42	48,279.75
负债合计		3,071,593.41	64,860.20
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	48,515,979.65	54,573,438.42
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	1,558,029.64	1,436,058.02
净资产合计		50,074,009.29	56,009,496.44
负债和净资产总计		53,145,602.70	56,074,356.64

注： 报告截止日 2025 年 06 月 30 日，长盛利鑫 90 天持有纯债 A 的基金份额净值为 1.0323 元，份额总额为 41,026,753.87 份；长盛利鑫 90 天持有纯债 C 的基金份额净值为 1.0311 元，份额总额为 7,489,225.78 份。基金份额总额 48,515,979.65 份。

6.2 利润表

会计主体：长盛利鑫 90 天持有期纯债债券型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 6 月 12 日（基金 合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日
一、营业总收入		306,790.51	379,165.61
1. 利息收入		16,536.72	379,165.61
其中：存款利息收入	6.4.7.13	15,168.12	15,411.86
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		1,368.60	363,753.75
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-” 填列）		376,098.43	-
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	376,098.43	-
资产支持证券投资 收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失 以“-”号填列）	6.4.7.20	-85,844.64	-
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.21	-	-
减：二、营业总支出		194,408.16	100,412.53
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	64,473.62	55,909.87
2. 托管费	6.4.10.2.2	10,745.61	9,318.33
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	20,493.50	29,699.44
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		40,334.21	-
其中：卖出回购金融资产支 出		40,334.21	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		261.02	-
8. 其他费用	6.4.7.23	58,100.20	5,484.89
三、利润总额（亏损总额以 “-”号填列）		112,382.35	278,753.08

减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		112,382.35	278,753.08
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		112,382.35	278,753.08

注：本基金合同于 2024 年 6 月 12 日生效，上年度可比期间自 2024 年 6 月 12 日至 2024 年 6 月 30 日。

6.3 净资产变动表

会计主体：长盛利鑫 90 天持有期纯债债券型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	54,573,438.42	1,436,058.02	56,009,496.44
二、本期期初净资产	54,573,438.42	1,436,058.02	56,009,496.44
三、本期增减变动额 （减少以“-”号填列）	-6,057,458.77	121,971.62	-5,935,487.15
（一）、综合收益总额	-	112,382.35	112,382.35
（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）	-6,057,458.77	9,589.27	-6,047,869.50
其中：1. 基金申购款	35,853,134.47	1,034,025.46	36,887,159.93
2. 基金赎回款	-41,910,593.24	-1,024,436.19	-42,935,029.43
（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	48,515,979.65	1,558,029.64	50,074,009.29
项目	上年度可比期间 2024 年 6 月 12 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计

一、上期期末净资产	-	-	-
二、本期期初净资产	378,831,050.38	-	378,831,050.38
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-	278,753.08	278,753.08
(一)、综合收益总额	-	278,753.08	278,753.08
(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)	-	-	-
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	378,831,050.38	278,753.08	379,109,803.46

注：本基金合同于 2024 年 6 月 12 日生效，上年度可比期间自 2024 年 6 月 12 日至 2024 年 6 月 30 日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

胡甲

基金管理人负责人

张壬午

主管会计工作负责人

龚珉

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

长盛利鑫 90 天持有期纯债债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2024]第 91 号《关于准予长盛利鑫 90 天持有期纯债债券型证券投资基金注册的批复》核准，由长盛基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛利鑫 90 天持有期纯债债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集，并于 2024 年 6 月 12 日募集成立。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利

息共募集人民币 378,645,101.78 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2024)第 0222 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《长盛利鑫 90 天持有期纯债债券型证券投资基金基金合同》于 2024 年 6 月 12 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 378,831,050.38 份基金份额,其中认购资金利息折合 185,948.60 份基金份额。本基金的基金管理人为长盛基金管理有限公司,基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《长盛利鑫 90 天持有期纯债债券型证券投资基金基金合同》和《长盛利鑫 90 天持有期纯债债券型证券投资基金招募说明书》,基金根据认购费用、申购费用与销售服务费收取方式的不同分为 A 类基金份额和 C 类基金份额。在投资者认购、申购时收取认购、申购费用、但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为 A 类基金份额;在投资者认购、申购时不收取认购、申购费用、而是从本别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类两种收费模式并存,各类基金份额分别计算基金份额净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛利鑫 90 天持有期纯债债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为固定收益类金融工具,包括债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、证券公司短期公司债券、政府支持机构债券及政府支持债、可分离交易可转债的纯债部分等债券及其他经中国证监会允许基金投资的债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款、通知存款及其他银行存款)、同业存单、货币市场工具、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金不投资于股票等权益类资产,也不投资于可转换债券(可分离交易可转债的纯债部分除外)、可交换债券。本基金的投资组合比例为:本基金对债券的投资比例不低于基金资产的 80%;每个交易日日终,在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后,现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:中债综合指数(全价)收益率。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《长盛利鑫 90 天持有期纯债债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
活期存款	689,940.80
等于：本金	689,511.36
加：应计利息	429.44
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	689,940.80

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		-	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	51,874,566.14	516,561.90	52,455,661.90	64,533.86
	合计	51,874,566.14	516,561.90	52,455,661.90	64,533.86
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-

合计	51,874,566.14	516,561.90	52,455,661.90	64,533.86
----	---------------	------------	---------------	-----------

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

无。

6.4.7.5 债权投资

无。

6.4.7.6 其他债权投资

无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

无。

6.4.7.8 其他资产

无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	8,555.60
其中：交易所市场	-
银行间市场	8,555.60
应付利息	-
预提费用	44,896.82
合计	53,452.42

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

长盛利鑫 90 天持有纯债 A

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	19,451,553.31	19,451,553.31
本期申购	35,644,683.98	35,644,683.98
本期赎回（以“-”号填列）	-14,069,483.42	-14,069,483.42
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	41,026,753.87	41,026,753.87

长盛利鑫 90 天持有纯债 C

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	35,121,885.11	35,121,885.11
本期申购	208,450.49	208,450.49
本期赎回（以“-”号填列）	-27,841,109.82	-27,841,109.82
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	7,489,225.78	7,489,225.78

注：若本基金有分红及转换业务，申购含红利再投、转换入；赎回含转换出。

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

长盛利鑫 90 天持有纯债 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	227,836.42	286,655.82	514,492.24
本期期初	227,836.42	286,655.82	514,492.24
本期利润	131,687.28	-8,757.16	122,930.12
本期基金份额交易产生的变动数	320,183.70	367,872.46	688,056.16
其中：基金申购款	508,479.43	520,284.52	1,028,763.95
基金赎回款	-188,295.73	-152,412.06	-340,707.79
本期已分配利润	-	-	-
本期末	679,707.40	645,771.12	1,325,478.52

长盛利鑫 90 天持有纯债 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	367,613.57	553,952.21	921,565.78
本期期初	367,613.57	553,952.21	921,565.78
本期利润	66,539.71	-77,087.48	-10,547.77
本期基金份额交易产生的变动数	-327,217.94	-351,248.95	-678,466.89
其中：基金申购款	2,479.95	2,781.56	5,261.51
基金赎回款	-329,697.89	-354,030.51	-683,728.40
本期已分配利润	-	-	-

本期末	106,935.34	125,615.78	232,551.12
-----	------------	------------	------------

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	15,168.12
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	—
其他	—
合计	15,168.12

6.4.7.14 股票投资收益

无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
债券投资收益——利息收入	488,156.33
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-112,057.90
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	376,098.43

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	143,040,980.40
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	141,463,603.88
减：应计利息总额	1,682,138.67
减：交易费用	7,295.75
买卖债券差价收入	-112,057.90

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

无。

6.4.7.18 衍生工具收益

无。

6.4.7.19 股利收益

无。

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-85,844.64
股票投资	-
债券投资	-85,844.64
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动 产生的预估增值税	-
合计	-85,844.64

6.4.7.21 其他收入

无。

6.4.7.22 信用减值损失

无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
审计费用	2,479.70
信息披露费	33,417.12
证券出借违约金	-
银行费用	3,603.38
账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	58,100.20

6.4.7.24 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

财政部、税务总局于 2025 年 7 月 31 日发布《财政部 税务总局关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》（财政部 税务总局公告 2025 年第 4 号），规定自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。

除以上情况外，无其他需要说明的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内，未存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
长盛基金管理有限公司（“长盛基金公司”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 6 月 12 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	64,473.62	55,909.87
其中：应支付销售机构的客户维护费	24,535.94	26,452.74

应支付基金管理人的净管理费	39,937.68	29,457.13
---------------	-----------	-----------

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.30%的年管理费率计提。计算方法如下：

$H=E\times\text{年管理费率}/\text{当年天数}$
H 为每日应计提的基金管理费
E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 6 月 12 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	10,745.61	9,318.33

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.05%的年托管费率计提。计算方法如下：

$H=E\times\text{年托管费率}/\text{当年天数}$
H 为每日应计提的基金托管费
E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长盛利鑫 90 天持有纯 债 A	长盛利鑫 90 天持有纯 债 C	合计
交通银行	-	19,707.76	19,707.76
国元证券	-	176.27	176.27
合计	-	19,884.03	19,884.03
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2024 年 6 月 12 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长盛利鑫 90 天持有纯 债 A	长盛利鑫 90 天持有纯 债 C	合计
交通银行	-	26,220.11	26,220.11

国元证券	-	49.01	49.01
合计	-	26,269.12	26,269.12

注：基金销售服务费每日计提，按月支付。本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的年销售服务费率为 0.20%。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 类基金份额前一日基金资产净值

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易
无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
	长盛利鑫 90 天持有纯债 A	长盛利鑫 90 天持有纯债 C
基金合同生效日（2024 年 6 月 12 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	4,869,472.04	-
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	4,869,472.04	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	11.8690%	-
项目	上年度可比期间 2024 年 6 月 12 日（基金合同生效	上年度可比期间 2024 年 6 月 12 日（基金合同

	日) 至 2024 年 6 月 30 日	生效日) 至 2024 年 6 月 30 日
	长盛利鑫 90 天持有纯债 A	长盛利鑫 90 天持有纯债 C
基金合同生效日 (2024 年 6 月 12 日) 持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
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	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

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，对于分级基金，比例的分母采用各自级别的份额。

6. 4. 10. 5. 2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6. 4. 10. 6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 6 月 12 日 (基金合同生效日) 至 2024 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行	689, 940. 80	15, 168. 12	1, 113, 266. 55	15, 411. 86
合计	689, 940. 80	15, 168. 12	1, 113, 266. 55	15, 411. 86

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。

6. 4. 10. 7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6. 4. 10. 8 其他关联交易事项的说明

无。

6. 4. 11 利润分配情况

无。

6. 4. 12 期末 (2025 年 6 月 30 日) 本基金持有的流通受限证券

6. 4. 12. 1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2025 年 06 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 3,000,669.94 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
240431	24 农发 31	2025 年 7 月 4 日	101.14	34,000	3,438,665.92
合计				34,000	3,438,665.92

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制管理委员会为核心的、由风险控制管理委员会、风险控制委员会、监察稽核部与风险管理部、相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部与风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，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，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管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	10,128,435.62
合计	-	10,128,435.62

注：上述评级均取自第三方评级机构。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
AAA	12,467,822.30	-
AAA 以下	-	-
未评级	39,987,839.60	36,852,511.50
合计	52,455,661.90	36,852,511.50

注：上述评级均取自第三方评级机构。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于本报告期末，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一年以内且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	689,511.36	-	-	429.44	689,940.80
交易性金融资产	21,085,200.00	20,375,900.00	10,478,000.00	516,561.90	52,455,661.90
资产总计	21,774,711.36	20,375,900.00	10,478,000.00	516,991.34	53,145,602.70
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	12,410.21	12,410.21
应付托管费	-	-	-	2,068.37	2,068.37
卖出回购金融资产款	2,999,875.50	-	-	794.44	3,000,669.94
应付销售服务费	-	-	-	1,315.95	1,315.95
应交税费	-	-	-	1,676.52	1,676.52
其他负债	-	-	-	53,452.42	53,452.42
负债总计	2,999,875.50	-	-	71,717.91	3,071,593.41
利率敏感度缺口	18,774,835.86	20,375,900.00	10,478,000.00	445,273.43	50,074,009.29
上年度末 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	8,987,271.19	-	-	4,600.38	8,991,871.57
交易性金融资产	15,534,300.00	30,918,000.00	-	528,647.12	46,980,947.12
应收申购款	-	-	-	101,537.95	101,537.95
资产总计	24,521,571.19	30,918,000.00	-	634,785.45	56,074,356.64
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	10,020.63	10,020.63
应付托管费	-	-	-	1,670.10	1,670.10
应付销售服务费	-	-	-	4,889.72	4,889.72
其他负债	-	-	-	48,279.75	48,279.75
负债总计	-	-	-	64,860.20	64,860.20
利率敏感度缺口	24,521,571.19	30,918,000.00	-	569,925.25	56,009,496.44

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2025 年 6 月 30 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
	1. 市场利率下降 25 个基点	348,667.23	206,812.77
	2. 市场利率上升 25 个基点	-348,667.23	-206,812.77

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：
第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。
第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。
第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
---------------	------------------------	--------------------------

第一层次	—	—
第二层次	52,455,661.90	46,980,947.12
第三层次	—	—
合计	52,455,661.90	46,980,947.12

6.4.14.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(上年度末：同)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括以摊余成本计量的金融资产和金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	—	—
	其中：股票	—	—
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	52,455,661.90	98.70
	其中：债券	52,455,661.90	98.70
	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	689,940.80	1.30
8	其他各项资产	-	-
9	合计	53,145,602.70	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有境内投资股票。

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 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。

7.4.2 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。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未进行股票投资。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	10,500,823.37	20.97
2	央行票据	-	-
3	金融债券	15,262,263.29	30.48
	其中：政策性金融债	12,136,467.95	24.24
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	26,692,575.24	53.31
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	52,455,661.90	104.76

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	-------	------	--------------

1	240431	24 农发 31	120,000	12,136,467.95	24.24
2	240011	24 付息国债 11	100,000	10,500,823.37	20.97
3	102382579	23 长春轨交 MTN002(碳中和债)	30,000	3,205,922.47	6.40
4	102481214	24 海淀国资 MTN002B	30,000	3,135,794.47	6.26
5	2028037	20 光大银行永续债	30,000	3,125,795.34	6.24

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.10.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.11 投资组合报告附注

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

20 光大银行永续债：

2025 年 1 月 27 日，银罚决字(2024)31 号显示，中国光大银行股份有限公司存在违反账户管理规定等 11 项违法违规事实，被处警告，没收违法所得 201.77033 万元，罚款 1,677.06009 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。

7.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金本报告期末未持有股票。

7.11.3 期末其他各项资产构成

无。

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人 户数 (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 (%)
长盛利鑫 90 天持有 纯债 A	75	547,023.38	33,657,735.90	82.04	7,369,017.97	17.96
长盛利鑫 90 天持有 纯债 C	133	56,309.97	10,002.25	0.13	7,479,223.53	99.87
合计	208	233,249.90	33,667,738.15	69.40	14,848,241.50	30.60

注：对于分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对于合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额），户均持有的基金份额的合计数=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管 理人所有从业 人员持有本基 金	长盛利鑫 90 天持有纯债 A	10,207.06	0.0249
	长盛利鑫 90 天持有纯债 C	50,271.61	0.6713
	合计	60,478.67	0.1247

注：对于分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对于合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
----	------	-------------------

本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	长盛利鑫 90 天持有纯债 A	0~10
	长盛利鑫 90 天持有纯债 C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	长盛利鑫 90 天持有纯债 A	0
	长盛利鑫 90 天持有纯债 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	长盛利鑫 90 天持有纯债 A	长盛利鑫 90 天持有纯债 C
基金合同生效日（2024 年 6 月 12 日）基金份额总额	76,974,282.15	301,856,768.23
本报告期期初基金份额总额	19,451,553.31	35,121,885.11
本报告期基金总申购份额	35,644,683.98	208,450.49
减：本报告期基金总赎回份额	14,069,483.42	27,841,109.82
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	41,026,753.87	7,489,225.78

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

10.2.1 本基金管理人的高级管理人员重大人事变动情况
本报告期内本基金管理人的高级管理人员未发生重大人事变动。

10.2.2 基金经理的变动情况
本报告期内本基金基金经理未发生变动。

10.2.3 本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况
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。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略没有改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的会计师事务所为立信会计师事务所（特殊普通合伙），本报告期内本基金未更换会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，管理人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

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

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。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	长盛基金管理有限公司关于旗下基金参加中信证券股份有限公司费率优惠	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网	2025 年 1 月 20 日

	活动的公告	站	
2	长盛基金管理有限公司关于旗下基金参加中信期货有限公司费率优惠活动的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025 年 1 月 20 日
3	长盛基金管理有限公司关于旗下基金参加中信证券华南股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025 年 1 月 20 日
4	长盛基金管理有限公司关于旗下基金参加中信证券（山东）有限责任公司费率优惠活动的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025 年 1 月 20 日
5	长盛基金管理有限公司旗下基金 2024 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025 年 1 月 22 日
6	长盛利鑫 90 天持有期纯债债券型证券投资基金 2024 年第 4 季度报告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025 年 1 月 22 日
7	长盛基金管理有限公司关于增加国泰君安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	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025 年 3 月 14 日
8	长盛利鑫 90 天持有期纯债债券型证券投资基金 2024 年年度报告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025 年 3 月 29 日
9	长盛基金管理有限公司旗下基金 2024 年年度报告提示性公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025 年 3 月 29 日
10	长盛基金管理有限公司旗下基金 2025 年 1 季度报告提示性公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025 年 4 月 22 日
11	长盛利鑫 90 天持有期纯债债券型证券投资基金 2025 年第 1 季度报告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025 年 4 月 22 日
12	长盛利鑫 90 天持有期纯债债券型证券投资基金（长盛利鑫 90 天持有纯债 C 份额）基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025 年 4 月 29 日
13	长盛利鑫 90 天持有期纯债债券型证券投资基金（长盛利鑫 90 天持有纯债 A 份额）基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025 年 4 月 29 日
14	关于长盛利鑫 90 天持有期纯债债券型证券投资基金基金资产净值连续低于 5000 万元的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025 年 4 月 29 日
15	长盛利鑫 90 天持有期纯债债券型证券投资基金招募说明书（更新）	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025 年 4 月 29 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比(%)
机构	1	20250416~20250506	4,869,472.04	0.00	0.00	4,869,472.04	10.04
	2	20250506~20250630	0.00	24,907,999.50	0.00	24,907,999.50	51.34
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。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期内无影响投资者决策的其他重要信息。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、长盛利鑫 90 天持有期纯债债券型证券投资基金相关批准文件；
- 2、《长盛利鑫 90 天持有期纯债债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长盛利鑫 90 天持有期纯债债券型证券投资基金托管协议》；
- 4、《长盛利鑫 90 天持有期纯债债券型证券投资基金招募说明书》；
- 5、法律意见书；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照。

12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的办公地址。

12.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人长盛基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-888-2666、010-86497888。

网址：<http://www.csfund.com.cn>。

长盛基金管理有限公司

2025 年 8 月 30 日